

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成29年5月12日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	山村 政 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3111
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース 通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コース 通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース 通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース （総称を「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）」とします。）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	継続申込期間（平成29年5月13日から平成30年5月11日まで） 各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で40兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース  
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コース  
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース  
通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース

（注1）以下「当ファンド」という場合、上記を総称して、またはそれぞれを指しているものとします。

（注2）上記を、それぞれ「為替ヘッジなしコース」、「日本円コース」、「ブラジル・リアル・コース」、「通貨セレクト・コース」という場合があります。

（注3）上記の総称を「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）」とします。

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### (3) 【発行(売出)価額の総額】

各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で40兆円を上限とします。

### (4) 【発行(売出)価格】

各ファンドについて、1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

## (5) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.24%（税抜3.0%）となっています。  
具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）

## &lt;スイッチング（乗換え）について&gt;

- ・「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）」を構成する各ファンドの受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって、他の構成ファンドの受益権の取得申込みを行なうことをいいます。
- ・スイッチング（乗換え）の申込みの際には、換金の申込みを行なうファンドと、取得の申込みを行なうファンドをご指示下さい。
- ・スイッチング（乗換え）にかかる申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。なお、スイッチング（乗換え）によるお買付時の申込手数料を徴収している販売会社はありません。スイッチング（乗換え）によるお買付時の申込手数料については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

## （「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）」の構成）



申込手数料には、消費税等が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

## (6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）

## (7) 【申込期間】

平成29年5月13日から平成30年5月11日まで（継続申込期間）  
（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

## (8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

## (9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

## (10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

## (11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

## (12) 【その他】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

次のイ．およびロ．に掲げる日を申込受付日とする受益権の取得の申込み（スイッチング（乗換え）にかかるものを含みます。）の受付は行ないません。また、次のイ．およびハ．に掲げる日を申込受付日とする受益権の換金の申込み（スイッチング（乗換え）にかかるものを含みます。）の受付は行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日（当ファンドの運営および受益者に与える影響が軽微であるとして委託会社が定める日に限り除きます。）

ハ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日  
申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

委託会社の各営業日（ ）の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したもの）（スイッチング（乗換え）にかかるものを含みます。以下同じ。）を、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日（ ）の取扱いとなります。

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場をいい、単に「取引所」ということがあります。以下同じ。）等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受付を中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）」を構成する各ファンドの受益者が当該ファンドの換金の手取金をもって他の構成ファンドの受益権の取得申込みをする場合において、当該他の構成ファンドの受益権の取得申込みの受付が中止された場合、当該換金請求の申込みの受付を中止することがあります。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合））
	決算頻度	年12回（毎月）
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファンド・オブ・ファンズ
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コース

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合））
	決算頻度	年12回（毎月）
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファンド・オブ・ファンズ
	為替ヘッジ	為替ヘッジあり （＜ファンドの特色＞3をご参照下さい。）

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

## （注1）商品分類の定義

- ・「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「内外」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- ・「資産複合」...目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

## （注2）属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「資産複合」...目論見書等において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるもの
- ・「年12回（毎月）」...目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」...目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファンド・オブ・ファンズ」...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの
- ・「為替ヘッジあり」...目論見書等において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行なう旨の記載があるもの

## 商品分類表

[通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 為替ヘッジなしコース]

[通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 日本円コース]

[通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) ブラジル・リアル・コース]

[通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 通貨セレクト・コース]

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

[通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 為替ヘッジなしコース]

[通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) ブラジル・リアル・コース]

[通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 通貨セレクト・コース]

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア		
不動産投信		中南米		
その他資産 (投資信託証券) (資産複合)	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( )	その他 ( )	中近東 (中東)		
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

## 属性区分表 [通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型) 日本円コース]

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり (ファンドの特色) <sup>3</sup> (をご参照下さい)
	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア		
不動産投信		中南米		
その他資産 (投資信託証券) (資産複合)	日々	アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( )	その他 ( )	中近東 (中東)		
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、各ファンドについて5,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。



## &lt; ファンドの特色 &gt;



世界各国のさまざまな資産に投資します。



投資環境に応じて、  
各資産の配分比率を機動的に調整します。



為替取引を活用します。

◆当ファンドには「為替ヘッジなしコース」と為替取引を行なう3つのコースがあります。

為替ヘッジなしコース

日本円コース

ブラジル・リアル・コース

通貨セレクト・コース

※4つのコースの間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。



毎月18日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、  
収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。



## 世界各国のさまざまな資産に投資します。

### ◆世界各国のさまざまな資産（注）から投資魅力度が高いものを発掘し、投資します。

（注）デリバティブ取引、為替取引その他の取引を含みます。

#### 投資する資産の例

株式	債券	その他
● 高配当株式	● 投資適格債券 ● ハイ・イールド債券	● 優先証券 ● リート ● バンクローン ● MLP ● 資産担保証券 ● デリバティブ取引

※上記以外にも投資する場合があります。

#### その他の資産について

優先証券：債券と株式の性質を併せ持つ証券。法的弁済順位は普通株式より優先され、劣後債より劣る。

バンクローン：銀行などの金融機関が、主に格付けが投資適格未満の事業会社等に対して行なう貸付の債権。

資産担保証券：不動産ローンや自動車ローン等の債権を担保として発行された証券。

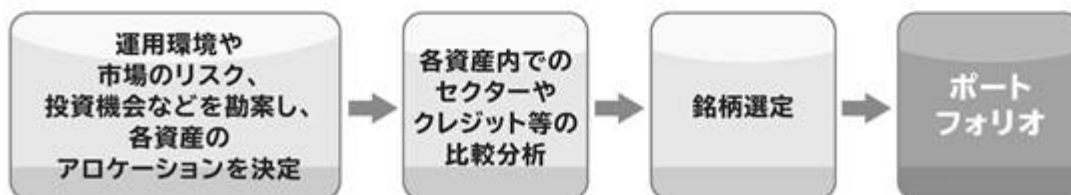
M L P：米国で行なわれている共同投資事業形態のひとつであり、その出資持分が米国の金融商品取引所等で取引されている。



## 投資環境に応じて、 各資産の配分比率を機動的に調整します。

- ◆運用は、ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インクが行ないます。
- ◆投資環境に応じて、適切なリスク管理のもと、各資産の配分比率を機動的に変更します。
- ◆各資産内の詳細な分析にもとづき、各資産の専任運用チームが銘柄選定を行ないます。

#### 運用プロセス



トップダウンによる各資産の分析

ボトムアップによる銘柄選定

## ブラックロック・グループについて

- ・ブラックロック・グループは、世界最大級の独立系資産運用グループであり、運用資産残高は2016年12月末現在5.15兆米ドル(約600兆円)です。
- ・同グループは、世界各国の機関投資家および個人投資家のため、株式、債券、キャッシュ・マネジメントおよびオルタナティブ商品といった様々な資産クラスの運用を行なっています。また、機関投資家向けに、リスク管理、投資システム・アウトソーシングおよびファイナンシャル・アドバイザー・サービスの提供を行なっています。



## 3 為替取引を活用します。

- ◆当ファンドには4つのコースがあります。
- ◆「為替ヘッジなしコース」では、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ◆「為替ヘッジなしコース」以外では、以下の為替取引を行ないます。
  - ①「投資対象とする資産の通貨売り(注)／米ドル買い」の為替取引を行ないます。
  - ②ファンドの純資産に対して、「米ドル売り／取引対象通貨買い」の為替取引を行ないます。

(注)一部の通貨について、為替取引が困難、あるいは、取引コストが過大と判断される際には、①の為替取引を行わない場合があります。

コース名	為替取引の内容	取引対象通貨
為替ヘッジなしコース	—————	—————
日本円コース	米ドル売り／日本円買い (為替ヘッジを行ないます。)	日本円
ブラジル・レアル・コース	米ドル売り／ブラジル・レアル買い	ブラジル・レアル
通貨セレクト・コース	米ドル売り／選定通貨買い	選定通貨

※4つのコースの間でスイッチング(乗換え)を行なうことができます。

- ◆「通貨セレクト・コース」において、選定通貨とは、次の<通貨の運用方針>により、為替取引の対象通貨として選定された通貨をいいます。

## &lt;通貨の運用方針&gt;

- 原則として、「シティ世界国債インデックス」および「JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット ブロード」の構成国の通貨の中から、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、6つの通貨を選定します。  
※上記指数構成国の通貨以外の通貨を選定する場合があります。
- 選定通貨の投資比率は、金利水準、リスク水準等を考慮して決定します。
- 選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。

- ◆上記の為替取引および通貨選定は大和証券投資信託委託株式会社が行ないます。

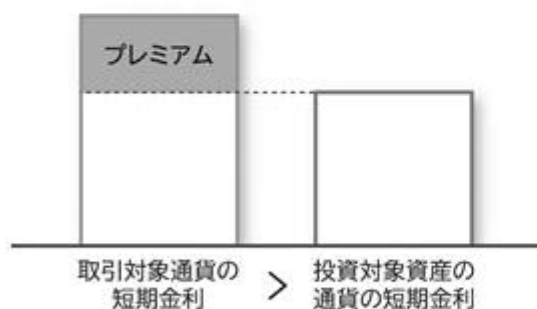
## 為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）／コスト（金利差相当分の費用）について

- ◆取引対象通貨の短期金利が、投資対象資産の通貨の短期金利よりも高い場合、「プレミアム（金利差相当分の収益）」が期待できます。
- ◆取引対象通貨の短期金利が、投資対象資産の通貨の短期金利よりも低い場合、「コスト（金利差相当分の費用）」が生じます。

$$\text{プレミアム／コスト（金利差相当分の収益／費用）} = \text{取引対象通貨の短期金利} - \text{投資対象資産の通貨の短期金利}$$

● 日本円  
 ● ブラジル・リアル  
 ● 選定通貨

## ●プレミアムが期待できるケース



## ●コストが生じるケース



※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。

※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。

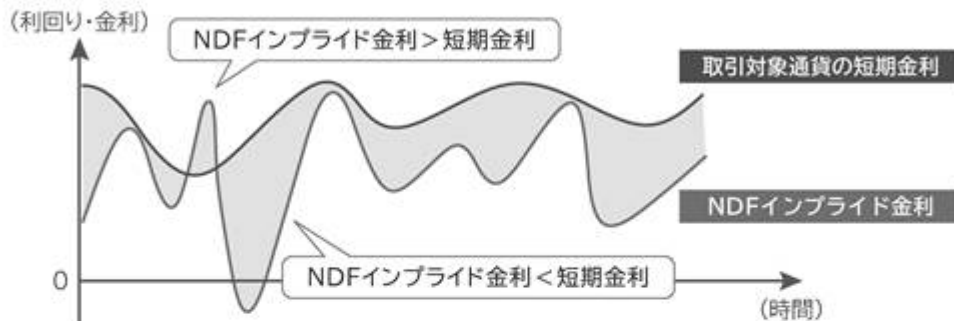
※実際の為替取引によるプレミアム／コストの水準は、需給要因等によって金利差相当分とは異なる水準となり、プレミアムの縮小、コストの拡大が生じることがあります。

※取引対象通貨が新興国通貨の場合、為替取引を行なう際にNDF（ノン・デリバラブル・フォワード）取引を利用することがあります。NDF取引を用いて為替取引を行なう際、プレミアム／コストは、需給や規制等の影響により、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

## NDF取引とは

- ◆取引対象通貨を用いた受け渡しは行わず、米ドル等の主要通貨による差金決済を相対で行なう取引です。
- ◆NDF取引価格から算出される“NDFインプライド金利”は、市場の流動性が低く、割高や割安を是正する動き（裁定）が働きにくいことから、市場参加者の期待や需給などの要因により、取引対象通貨の短期金利の水準から大きく乖離する場合があります。

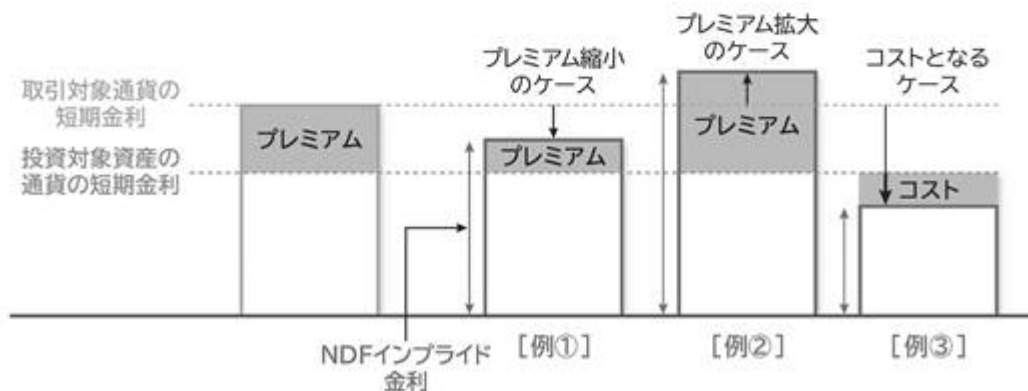
### NDFインプライド金利と取引対象通貨の短期金利が乖離するイメージ



※上記はイメージであり、当ファンドのパフォーマンスとは異なります。

## NDFインプライド金利の変動の影響

- ◆市場参加者の通貨上昇（下落）期待や需給などにより、NDFインプライド金利は低く（高く）なる可能性があります。NDFインプライド金利が取引対象通貨の短期金利より低く（高く）なると、為替取引によるプレミアム（金利差相当分の収益）が縮小【例①】（拡大【例②】）し、場合によっては為替取引によるコスト（金利差相当分の費用）となるケース【例③】もあります。



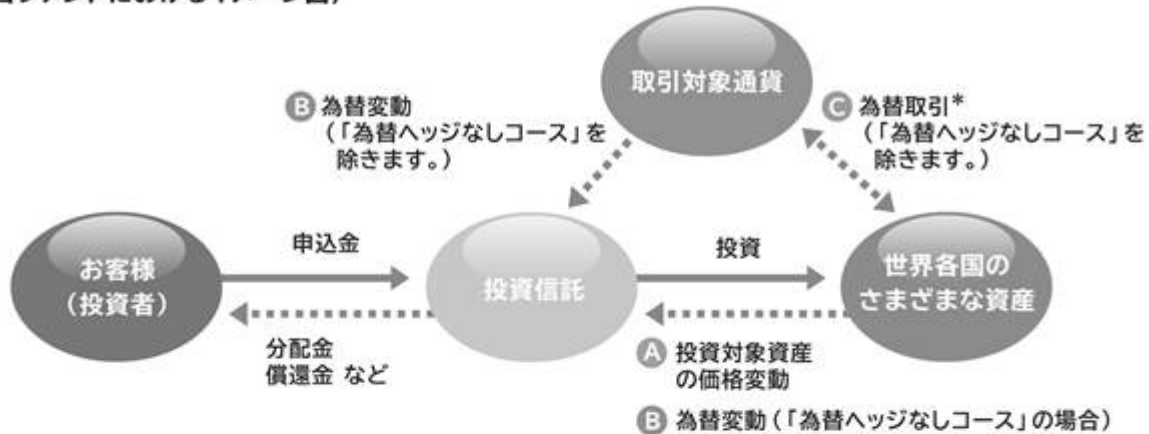
※上記はイメージであり、実際のプレミアム／コストとは異なります。

※上記は投資成果を示唆、保証するものではありません。

## 通貨選択型ファンドの収益のイメージ

- 通貨選択型の投資信託は、株式や債券などといった投資対象資産に加えて、為替取引の対象となる円以外の通貨も選択することができるよう設計された投資信託です。

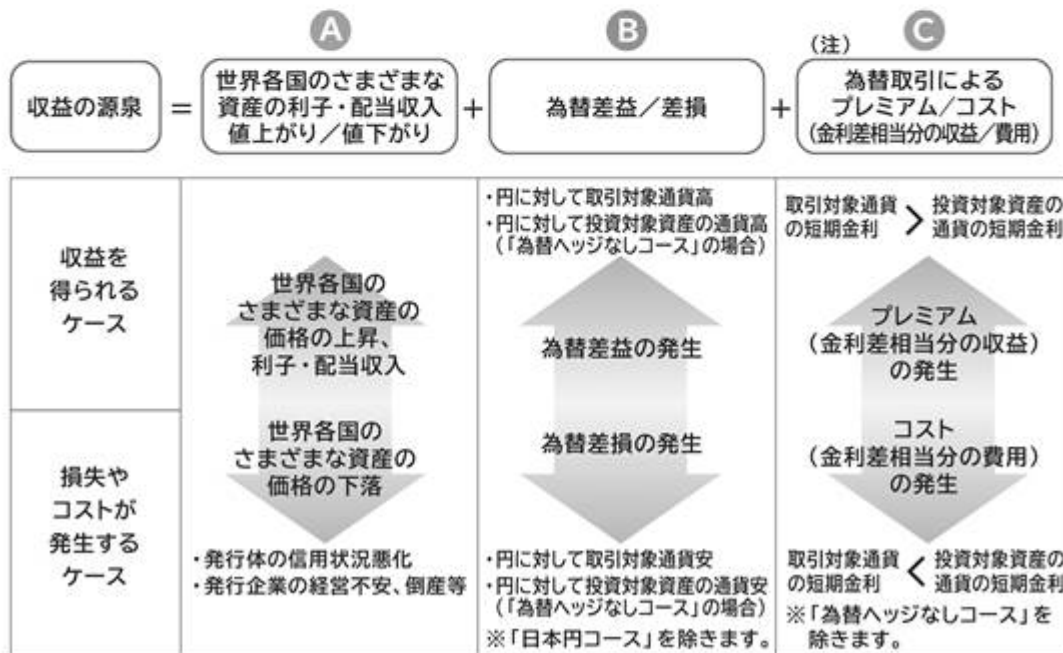
〈当ファンドにおけるイメージ図〉



\*取引対象通貨が円以外の場合には、当該取引対象通貨の対円での為替リスクが発生することに留意が必要です。

- 当ファンドの収益源としては、以下の3つの要素が挙げられます。

これらの収益源に相応してリスクが内在していることに注意が必要です。

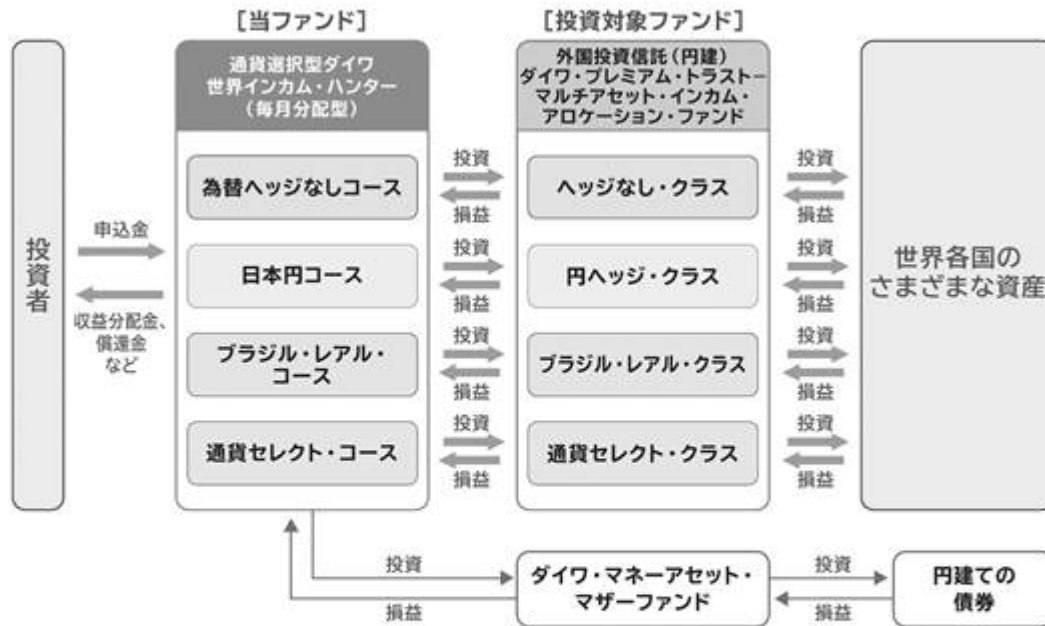


(注) 為替取引を行なう際にNDF取引を利用することがあります。NDF取引を用いて為替取引を行なう際に、プレミアム／コストは、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

※上記はイメージであり、実際の投資成果を示唆、保証するものではありません。

## ファンドの仕組み

- ◆当ファンドは、複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- ◆外国投資信託の受益証券を通じて、世界各国のさまざまな資産に投資し、「為替ヘッジなしコース」を除き、投資対象とする資産について為替取引を行ないません。



※4つのコースの間でスイッチング（乗換え）を行なうことができます。

※投資対象ファンドについて、くわしくは、「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

- 当ファンドは、通常の状態では、投資対象とする外国投資信託への投資割合を高位に維持することを基本とします。

- 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1～3の運用が行なわれないことがあります。



毎月18日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、  
収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

### 〈分配方針〉

- ① 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ② 原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

### 収益分配のイメージ



※上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

※ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。



## [収益分配金に関する留意事項]

- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

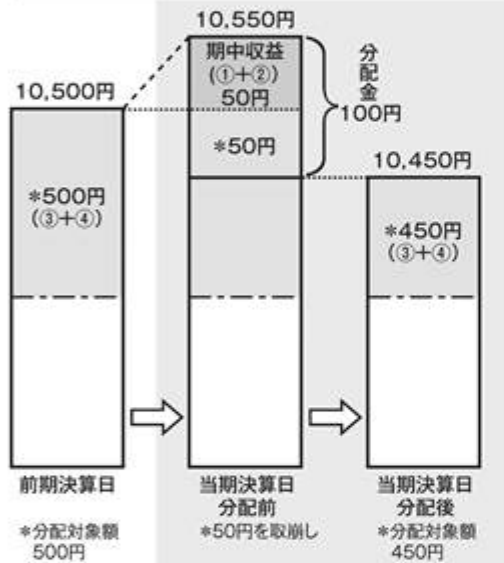
投資信託で分配金が  
支払われるイメージ



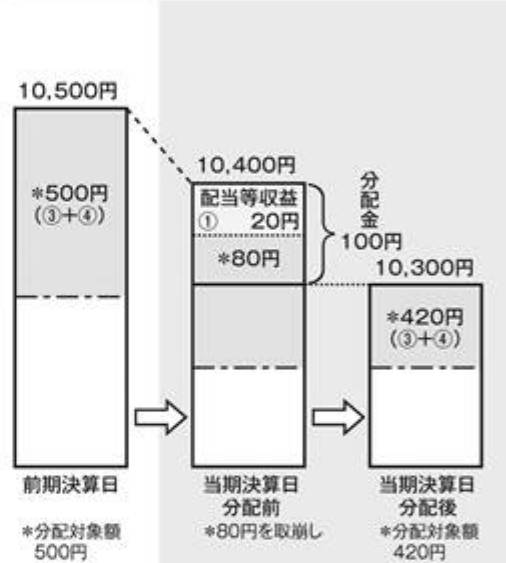
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)

(前期決算日から基準価額が上昇した場合)



(前期決算日から基準価額が下落した場合)

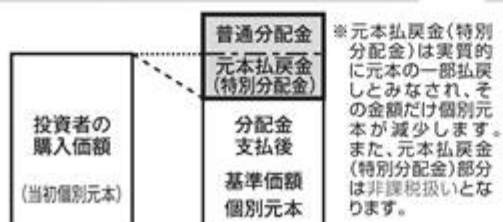


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

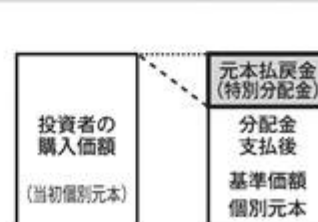
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご注意ください。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)



(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金 … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ(特別分配金)減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

### < 投資対象ファンドの概要 >

「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）」

「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」

「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」

「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(通貨セレクト・クラス)」

形態/表示通貨	ケイマン籍の外国投資信託/円建
運用の基本方針	(ヘッジなし・クラス) 世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。 (ヘッジなし・クラス)以外 世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替取引を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
主要投資対象	世界の株式、債券等

運用方針	<p>1. (ヘッジなし・クラス) 世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。</p> <p>(ヘッジなし・クラス)以外 世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替取引を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。</p> <p>2. ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針を基本とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 世界各国のさまざまな資産から投資魅力が高いものを発掘し投資します。</li> <li>・ 投資環境に応じて、マルチアセット・ポートフォリオ・ストラテジー・チームによる各資産の分析にもとづき、適切なリスク管理のもと、各資産の配分比率を機動的に変更します。</li> <li>・ マルチアセット・ポートフォリオ・ストラテジー・チームと各資産の専任運用チームによる、各資産内の詳細な分析にもとづき、各資産の専任運用チームが銘柄選定を行ないます。</li> <li>・ 運用の効率化を図るため、デリバティブ取引や為替取引等を利用することがあります。</li> </ul> <p>3. (ヘッジなし・クラス) 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> <p>(円ヘッジ・クラス) 原則として、「投資対象とする資産の通貨売り( ) / 米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り / 日本円買い」の為替取引を行ない、為替変動リスクの低減をめざします。</p> <p>( )一部の通貨について、為替取引が困難、あるいは、取引コストが過大と判断される際には、為替取引を行なわない場合があるため、為替変動リスクは完全には排除できません。</p> <p>(ブラジル・レアル・クラス) 原則として、「投資対象とする資産の通貨売り( ) / 米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り / ブラジル・レアル買い」の為替取引を行ない、ブラジル・レアルへの投資成果の獲得をめざします。</p> <p>( )一部の通貨について、為替取引が困難、あるいは、取引コストが過大と判断される際には、為替取引を行なわない場合があります。</p> <p>(通貨セレクト・クラス) 原則として、「投資対象とする資産の通貨売り( <sup>1</sup> ) / 米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り / 選定通貨( <sup>2</sup> ) 買い」の為替取引を行ない、選定通貨への投資成果の獲得をめざします。</p> <p>( <sup>1</sup> )一部の通貨について、為替取引が困難、あるいは、取引コストが過大と判断される際には、為替取引を行なわない場合があります。</p> <p>( <sup>2</sup> )選定通貨とは、投資顧問会社が決定した複数の通貨をいいます。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 大和証券投資信託委託株式会社が投資顧問会社として通貨の選定および配分比率を決定します。</li> </ul> <p>&lt;通貨セレクト・クラスにおける通貨の運用方針&gt;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 原則として、シティ世界国債インデックスおよびJPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット ブロードの構成国の通貨の中から、金利水準、リスク水準、ファンダメンタルズ、流動性等を考慮し、6つの通貨を選定します。</li> <li>・ 上記指数構成国の通貨以外の通貨を選定する場合があります。</li> <li>・ 選定通貨の投資比率は、金利水準、リスク水準等を考慮して決定します。</li> <li>・ 選定通貨および投資比率は、原則、毎月見直します。</li> </ul> <p>4. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
設定日	2015年2月20日
信託期間	無期限

決算日	7月の最終営業日
収益分配	原則として、毎月分配を行ないます。
管理報酬等	（ヘッジなし・クラス） 純資産総額に対して年率0.77%程度 （円ヘッジ・クラス） （ブラジル・リアル・クラス） 純資産総額に対して年率0.80%程度 （通貨セレクト・クラス） 純資産総額に対して年率0.92%程度 この他に「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド」全体に対して、固定報酬として年額13,500米ドルがかかります。また、監査費用、弁護士費用、有価証券売買委託手数料等、投資対象ファンドの運営に必要な各種経費がかかります。
申込手数料	かかりません。
投資顧問会社	（ヘッジなし・クラス） ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク （ヘッジなし・クラス）以外 ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク 大和証券投資信託委託株式会社

## ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

形態 / 表示通貨	国内籍の証券投資信託 / 円建
運用の基本方針	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
投資態度	円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
設定日	平成24年3月22日
信託期間	無期限
決算日	毎年12月9日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	みずほ信託銀行株式会社

## (2) 【ファンドの沿革】

平成27年2月19日

信託契約締結、当初設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者
-----

お申込者
------

収益分配金（注）、償還金など	お申込金（ 3 ）
----------------	-----------

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3 ）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 3 ）	
受託会社	<p>みずほ信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 資産管理サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
損益 投資		
投資対象	投資対象ファンドの受益証券 など	

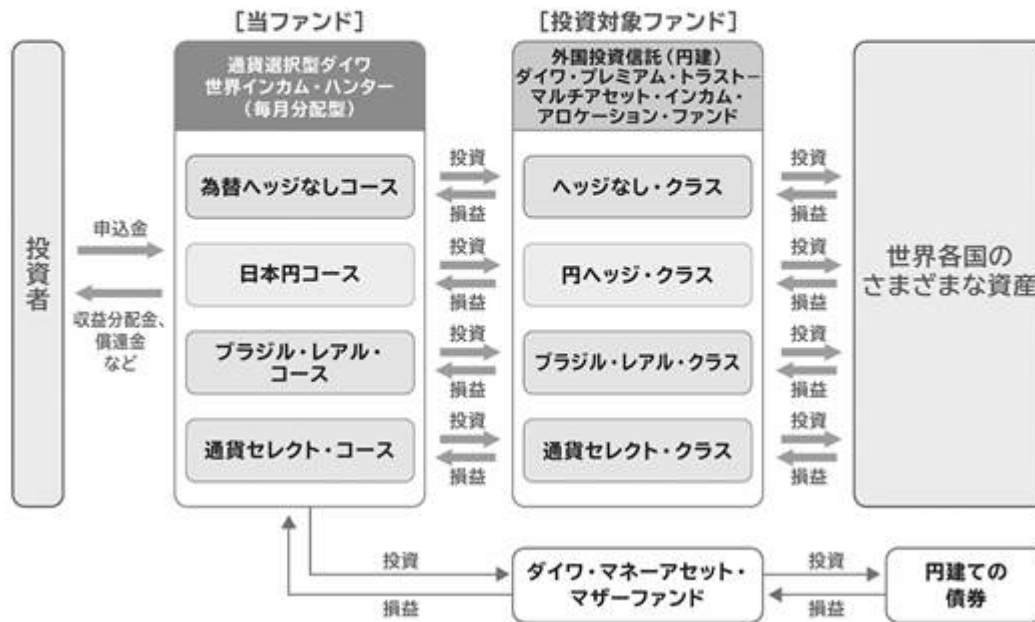
（注）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

## ファンドの仕組み

- ◆ 当ファンドは、複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。
- ◆ 外国投資信託の受益証券を通じて、世界各国のさまざまな資産に投資し、「為替ヘッジなしコース」を除き、投資対象とする資産について為替取引を行いません。



### < 委託会社の概況（平成29年2月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

#### ・ 沿革

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
昭和35年 4月 1日	営業開始
昭和60年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成 7年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成 7年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)

#### ・ 大株主の状況

名称	住所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

## &lt;為替ヘッジなしコース&gt;

## 主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）」（以下「インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券

## 投資態度

- イ. 主として、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
- ロ. 当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。
- ハ. インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）では、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。
- ニ. 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## &lt;日本円コース&gt;

## 主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

1. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」（以下「インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
2. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券

## 投資態度

- イ. 主として、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替ヘッジを行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
- ロ. 当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。
- ハ. インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）では、「投資対象とする資産の通貨売り（ ） / 米ドル買い」の為替取引を行ないません。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り / 日本円買い」の為替取引を行ない、為替変動リスクの低減をめざします。

一部の通貨について、為替取引が困難、あるいは、取引コストが過大と判断される際には、為替取引を行わない場合があるため、為替変動リスクは完全には排除できません。

二．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### <ブラジル・リアル・コース>

##### 主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

- 1．ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」（以下「インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
- 2．ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券

##### 投資態度

イ．主として、インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替取引を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

ロ．当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）では、「投資対象とする資産の通貨売り（ ） / 米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り / ブラジル・リアル買い」の為替取引を行ない、ブラジル・リアルへの投資成果の獲得をめざします。

一部の通貨について、為替取引が困難、あるいは、取引コストが過大と判断される際には、為替取引を行わない場合があります。

二．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### <通貨セレクト・コース>

##### 主要投資対象

次の有価証券を主要投資対象とします。

- 1．ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）」（以下「インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）」といいます。）の受益証券（円建）
- 2．ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券

##### 投資態度

イ．主として、インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）の受益証券への投資を通じて、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率



を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替取引を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

ロ．当ファンドは、インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）とダイワ・マネーアセット・マザーファンドに投資するファンド・オブ・ファンズです。通常の状態、インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）への投資割合を高位に維持することを基本とします。

ハ．インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）では、「投資対象とする資産の通貨売り（ 1）/米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り/選定通貨（ 2）買い」の為替取引を行ない、選定通貨への投資成果の獲得をめざします。

1 一部の通貨について、為替取引が困難、あるいは、取引コストが過大と判断される際には、為替取引を行なわない場合があります。

2 当ファンドにおいて、選定通貨とは、投資対象とする外国投資信託の投資顧問会社が選定した複数の通貨をいいます。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

#### <投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

##### 1. 為替ヘッジなしコース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）
選定の方針	主として、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざすファンドである。

##### 2. 日本円コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）
選定の方針	主として、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替変動リスクの低減をめざして為替ヘッジを行なうことで、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざすファンドである。

##### 3. ブラジル・リアル・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）
------------	----------------------------------------------------------

選定の方針	主として、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、ブラジル・レアルへの投資成果の獲得をめざして為替取引を行なうことで、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざすファンドである。
-------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

#### 4. 通貨セレクト・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(通貨セレクト・クラス)
選定の方針	主として、世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、選定通貨への投資成果の獲得をめざして為替取引を行なうことで、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざすファンドである。

くわしくは「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

#### (2) 【投資対象】

##### <為替ヘッジなしコース>

当ファンドにおいて投資の対象とする資産(本邦通貨表示のものに限ります。)の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
  - イ. 有価証券
  - ロ. 約束手形
  - ハ. 金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
  - イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1. に掲げる親投資信託(以下「マザーファンド」といいます。 )の受益証券、次の2. に掲げる外国投資信託(以下「組入外国投資信託」といいます。 )の受益証券、ならびに次の3. から5. までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。 )に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(ヘッジなし・クラス)」の受益証券(円建)
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3. の証券の性質を有するもの

5. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

前 の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前 に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

#### <日本円コース>

(為替ヘッジなしコースと同規定)

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.に掲げる親投資信託(以下「マザーファンド」といいます。 )の受益証券、次の2.に掲げる外国投資信託(以下「組入外国投資信託」といいます。 )の受益証券、ならびに次の3. から5. までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。 )に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(円ヘッジ・クラス)」の受益証券(円建)
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3. の証券の性質を有するもの
5. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

(為替ヘッジなしコースと同規定)

(為替ヘッジなしコースと同規定)

#### <ブラジル・リアル・コース>

(為替ヘッジなしコースと同規定)

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.に掲げる親投資信託(以下「マザーファンド」といいます。 )の受益証券、次の2.に掲げる外国投資信託(以下「組入外国投資信託」といいます。 )の受益証券、ならびに次の3. から5. までに掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有

価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができません。

1. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」の受益証券（円建）
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

（為替ヘッジなしコースと同規定）

（為替ヘッジなしコースと同規定）

#### <通貨セレクト・コース>

（為替ヘッジなしコースと同規定）

委託会社は、信託金を、主として、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された次の1.に掲げる親投資信託（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券、次の2.に掲げる外国投資信託（以下「組入外国投資信託」といいます。）の受益証券、ならびに次の3.から5.までに掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券
2. ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）」の受益証券（円建）
3. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
4. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前3.の証券の性質を有するもの
5. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前1.に掲げる投資信託の受益証券および前2.に掲げる外国投資信託の受益証券を「投資信託証券」といいます。

（為替ヘッジなしコースと同規定）

（為替ヘッジなしコースと同規定）

#### <投資先ファンドについて>

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は次のとおりです。

##### 1. 為替ヘッジなしコース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）
------------	-------------------------------------------------------

運用の基本方針	世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
主要な投資対象	世界の株式、債券等
委託会社等の名称	投資顧問会社： ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク

## 2. 日本円コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）
運用の基本方針	世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替ヘッジを行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。また、「投資対象とする資産の通貨売り/米ドル買い」の為替取引を行ないます。その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り/日本円買い」の為替取引を行ない、為替変動リスクの低減をめざします。
主要な投資対象	世界の株式、債券等
委託会社等の名称	投資顧問会社： ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク 大和証券投資信託委託株式会社

## 3. ブラジル・レアル・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・レアル・クラス）
運用の基本方針	世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替取引を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。為替取引とは、まず、「投資対象とする資産の通貨売り/米ドル買い」を行ない、その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り/ブラジル・レアル買い」を行なうことで、ブラジル・レアルへの投資成果の獲得をめざすものです。
主要な投資対象	世界の株式、債券等
委託会社等の名称	投資顧問会社： ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク 大和証券投資信託委託株式会社

## 4. 通貨セレクト・コース

投資先ファンドの名称	ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）
運用の基本方針	世界各国の高配当株式や債券など、さまざまな資産に投資を行ない、機動的に配分比率を調整することで、安定した利回りを追求するとともに、為替取引を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。為替取引とは、まず、「投資対象とする資産の通貨売り/米ドル買い」を行ない、その後、当該ファンドの純資産に対して、「米ドル売り/選定通貨買い」を行なうことで、選定通貨への投資成果の獲得をめざすものです。
主要な投資対象	世界の株式、債券等

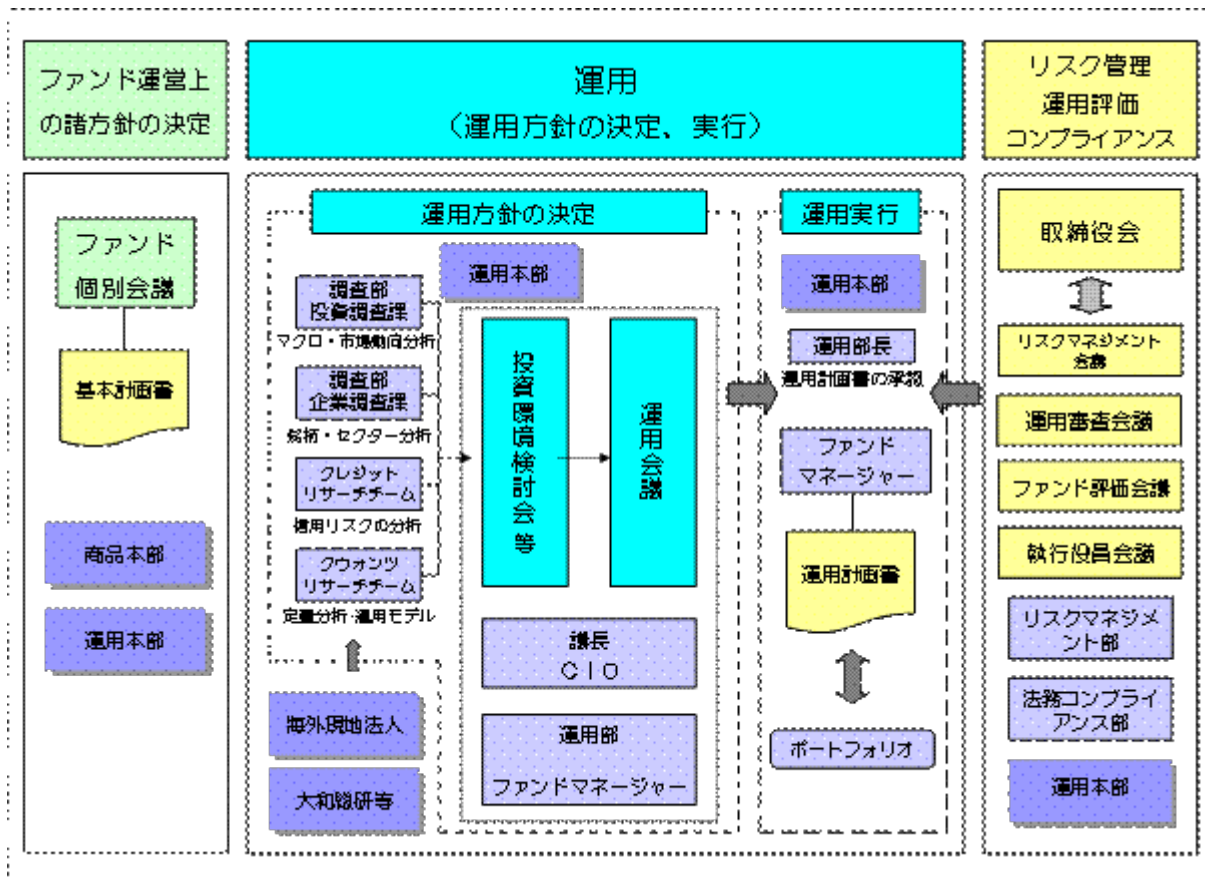
委託会社等の名称	投資顧問会社： ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク 大和証券投資信託委託株式会社
----------	----------------------------------------------------------

くわしくは、「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

### (3) 【運用体制】

#### 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



#### 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

##### イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

##### ロ．投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO (Chief Investment Officer) が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

##### ハ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

##### ニ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから

提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

#### 職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

##### イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

##### ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

##### ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

##### ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

##### ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

##### イ．ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

##### ロ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

##### ハ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

##### ニ．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

#### 受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

上記の運用体制は平成29年2月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

##### <各ファンド共通>

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

##### <各ファンド共通>

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産（信託約款）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 投資対象ファンドについて



1. ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ヘッジなし・クラス）
2. ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）
3. ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）
4. ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）

「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

#### 5. ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p>
償還条項	<p>信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。</p>

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、投資信託証券への投資を通じて、株式、公社債など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。

組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

新興国の証券市場は、先進国の証券市場に比べ、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向が考えられます。

#### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合には、公社債の価格は下落します。

組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

ハイ・イールド債券は、投資適格債券に比べ、一般に債務不履行が生じるリスクが高いと考えられます。ハイ・イールド債券は、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格の変動性が大きくなる傾向があります。

新興国の公社債は、先進国の公社債と比較して価格変動が大きく、債務不履行が生じるリスクがより高いものになると考えられます。

#### その他の価格変動

当ファンドはさまざまな資産を投資対象としています。

- ・優先証券は、発行体の財政難、経営不安等が生じた場合、または生じることが予想される場合には、優先証券の価格が大きく下落する可能性があります。
- ・リートの価格は、不動産市況の変動、リートの収益や財務内容の変動、リートに関する法制度の変更等の影響を受けます。
- ・バンクローンの価格は、債務者である事業会社等の信用状況により変動します。  
特に、債務者が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合に価格が下落します。また、一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより、価格の変動性が大きくなる傾向があります。
- ・資産担保証券の価格は、一般に金利が上昇した場合に下落します。また、担保となるローンは、一般に金利が低下すると借り換えが増加し、ローンの期限前償還が増加することにより、資産担保証券の価格は影響を受けます。
- ・MLPの多くは、主にエネルギーや天然資源に関わる特定の業種への投資となるため、市場動向にかかわらず基準価額の変動が大きくなる可能性があります。

デリバティブ取引を行なう場合、ファンドの基準価額は当該デリバティブ取引の価格変動の影響を受けます。

- ・先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建てている場合の先物価格の下落、または先物を売建てている場合の先物価格の上昇により損失が発生することがあります。
- ・カバードコールを行なう場合、対象資産の価格が上昇した場合の値上がり益が限定されるため、対象資産のみに投資した場合に対して投資成果が劣化する可能性があります。

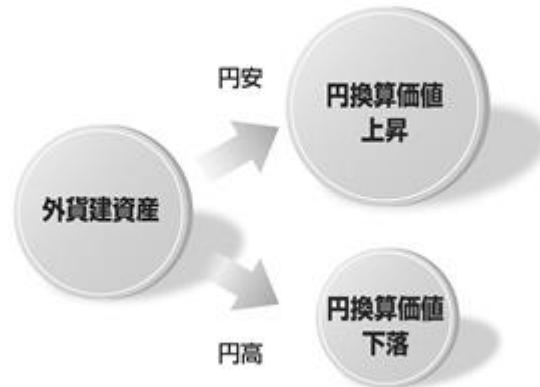
その他の価格変動は、上記に限定されるものではありません。

組入資産の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

〈為替変動のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

#### <為替ヘッジなしコース>

組入外貨建資産について、米ドルが円に対して米ドル安の方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。また米ドル以外の通貨の資産にも投資を行なうため、当該資産の通貨の為替変動の影響を受けます。

新興国通貨の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国通貨と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

#### <日本円コース>

為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行なう際、日本円の金利が投資対象資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

#### <ブラジル・リアル・コース、通貨セレクト・コース>

取引対象通貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

新興国通貨の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国通貨と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

投資対象資産の通貨の為替変動リスクを完全に排除することはできませんので、基準価額は円に対する投資対象資産の通貨の為替変動の影響を受ける場合があります。なお、取引対象通貨の金利が投資対象資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなり、需給要因等によっては、さらにコストが拡大することもあります。

<為替ヘッジなしコース>以外について、投資対象とする資産の通貨のうち一部の通貨について、為替取引が困難、あるいは、取引コストが過大と判断される際には、為替取引を行なわない場合があるため、取引対象通貨以外の為替変動の影響を受けることがあります。

各ファンドの投資対象である外国投資信託において、NDF取引を用いて為替取引を行なう場合、コストは需給や規制等の影響により、金利差から期待される水準と大きく異なる場合があります。

## ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。新興国への投資には、先進国と比べて大きなカントリー・リスクが伴います。

新興国の経済状況は、先進国経済に比較して脆弱である可能性があります。そのため、当該国のインフレ、国際収支、外貨準備高等の悪化、また、政治不安や社会不安あるいは他国との外交関係の悪化などが株式市場や為替市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、政府当局による海外からの投資規制など数々の規制が緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により証券市場が著しい悪影響を被る可能性もあります。

新興国においては、先進国と比較して、証券の決済、保管等にかかる制度やインフラストラクチャーが未発達であったり、証券の売買を行なう当該国の仲介業者等の固有の事由等により、決済の遅延、不能等が発生する可能性も想定されます。そのような場合、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

実質的な投資対象である証券が上場または取引されている新興国の税制は先進国と異なる場合があります。また、税制が変更されたり、あるいは新たな税制が適用されることにより、基準価額が影響を受ける可能性があります。

その他

イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

### (2) 換金性等が制限される場合

通常と異なる状況において、お買付け・ご換金に制限を設けることがあります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、お買付け、ご換金の申込みの受け付けを中止すること、すでに受け付けたお買付けの申込みを取消すことがあります。

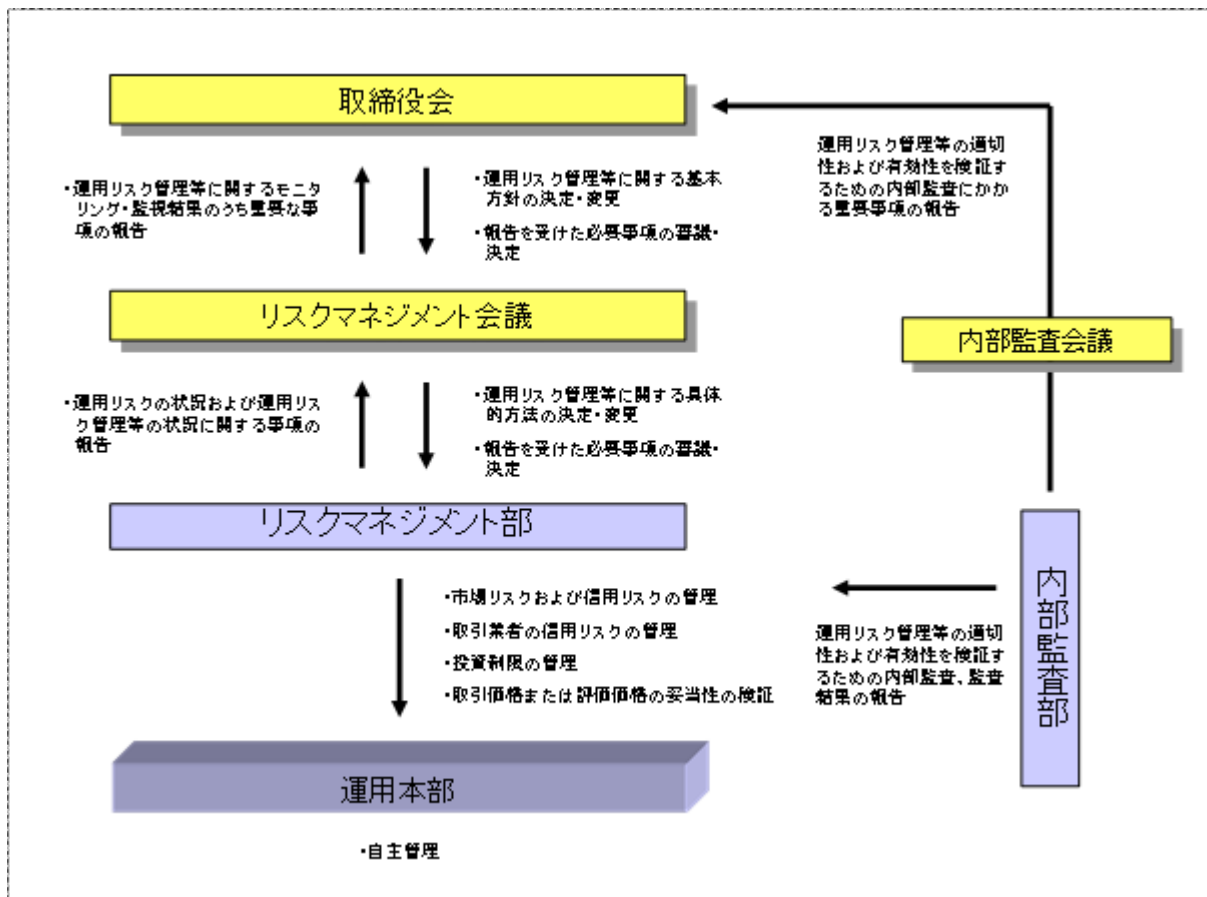
ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回することができます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

### (3) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

### (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

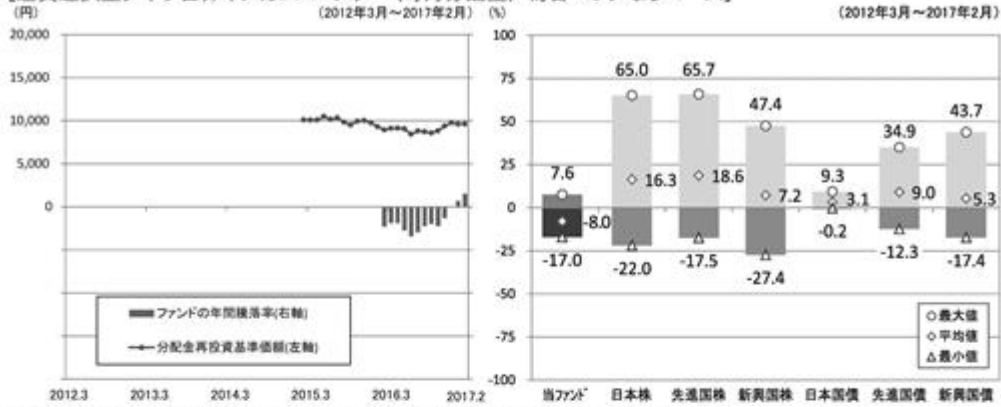
#### 参考情報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

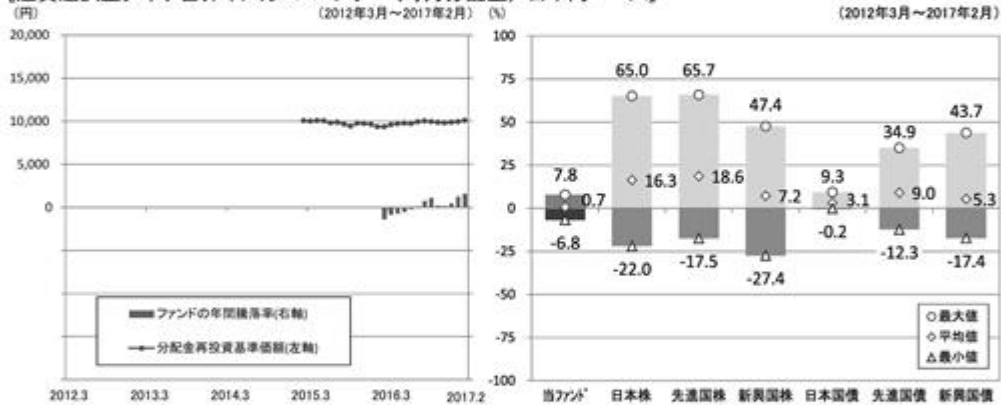
## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

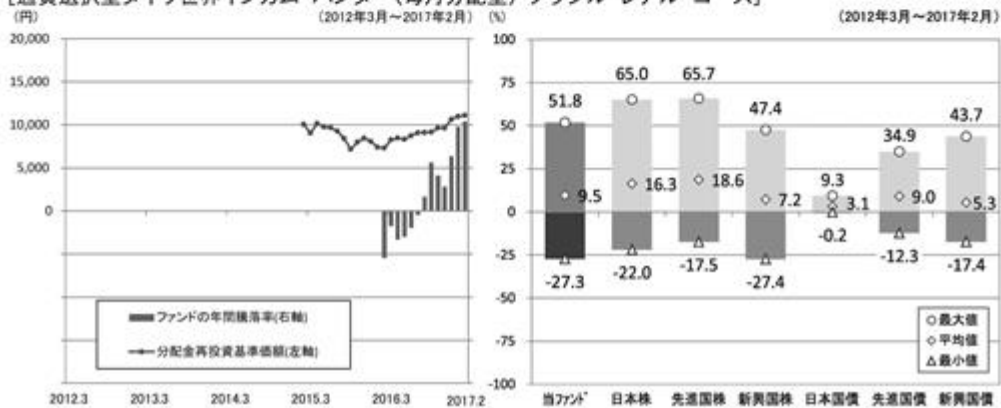
## [通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型） 為替ヘッジなしコース]



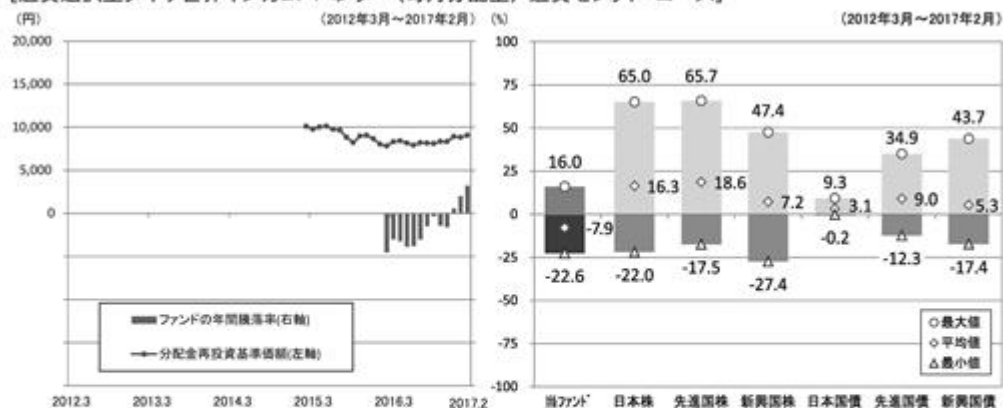
## [通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型） 日本円コース]



## [通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型） ブラジル・リアル・コース]



## 【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース】



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

## ※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）  
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）  
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）  
 日本国債：NOMURA-BPI国債  
 先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）  
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、3.24%（税抜3.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

## ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

## &lt;スイッチング（乗換え）について&gt;

- ・「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）」を構成する各ファンドの受益者が、保有する受益権を換金した手取金をもって、他の構成ファンドの受益権の取得申込みを行なうことをいいます。

- ・スイッチング（乗換え）の申込みの際には、換金の申込みを行なうファンドと、取得の申込みを行なうファンドをご指示下さい。
- ・スイッチング（乗換え）にかかる申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は、スイッチング（乗換え）の金額から差引かせていただきます。なお、スイッチング（乗換え）によるお買付時の申込手数料を徴収している販売会社はありません。スイッチング（乗換え）によるお買付時の申込手数料については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。



申込手数料には、消費税等が課されます。

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

## (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

## (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.215%（税抜1.125%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、純資産総額に対し次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.35% （税抜）	年率0.75% （税抜）	年率0.025% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。



前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

当ファンドの信託報酬等のほかに、投資対象ファンドに関しても信託報酬等がかかります。当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬等を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、「為替ヘッジなしコース」については年率1.985%（税込）程度、「日本円コース」、「ブラジル・リアル・コース」については年率2.015%（税込）程度、「通貨セレクト・コース」については年率2.135%（税込）程度です。（投資対象ファンド「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド」全体に対して、固定報酬として年額13,500米ドルがかかりますので、純資産総額によっては上回る場合があります。）

（注）投資対象ファンドの信託報酬等については、「1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」の「投資対象ファンドの概要」をご参照下さい。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（ ）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

#### <投資対象ファンドより支弁する手数料等>

各ファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。その他、マザーファンドを除く投資対象ファンドからは監査報酬を支弁します。

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

## 個人の投資者に対する課税

### イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

### ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

### ハ．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたN I S Aをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアN I S A」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

## 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- ( ) 上記は、平成29年2月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## 【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース】

## (1) 【投資状況】（平成29年2月28日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	2,549,354,414	98.43
内 ケイマン諸島	2,549,354,414	98.43
親投資信託受益証券	5,998,602	0.23
内 日本	5,998,602	0.23
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	34,788,688	1.34
純資産総額	2,590,141,704	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

## (2) 【投資資産】（平成29年2月28日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
			また は 額面金額			
1 MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON-HEDGED CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	29,099,894	87.82 2,555,639,991	87.60 2,549,354,414	98.43
2 ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,990,216	1.0014 5,998,602	1.0014 5,998,602	0.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.43%
親投資信託受益証券	0.23%
合計	98.66%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成27年8月18日)	8,573,713,205	8,594,777,708	1.0176	1.0201
第2特定期間末 (平成28年2月18日)	7,176,260,948	7,196,975,548	0.8661	0.8686
平成28年2月末日	7,059,397,652	-	0.8707	-
3月末日	6,671,518,702	-	0.8855	-
4月末日	5,990,799,360	-	0.8838	-
5月末日	5,575,026,048	-	0.8736	-
6月末日	4,893,762,395	-	0.8108	-
7月末日	4,876,839,922	-	0.8446	-
第3特定期間末 (平成28年8月18日)	4,651,532,510	4,665,845,117	0.8125	0.8150
8月末日	4,701,035,412	-	0.8339	-
9月末日	3,400,979,711	-	0.8181	-
10月末日	3,165,988,733	-	0.8394	-
11月末日	3,156,526,574	-	0.8886	-
12月末日	2,870,569,171	-	0.9223	-
平成29年1月末日	2,682,954,528	-	0.9074	-
第4特定期間末 (平成29年2月20日)	2,600,718,676	2,607,885,130	0.9073	0.9098
2月末日	2,590,141,704	-	0.9048	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0100
第2特定期間	0.0150
第3特定期間	0.0150
第4特定期間	0.0150

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	2.8
第2特定期間	13.4
第3特定期間	4.5
第4特定期間	13.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	3,122,893,534	131,809,762
第2特定期間	408,779,125	548,740,333
第3特定期間	68,353,325	2,629,150,677
第4特定期間	37,794,452	2,896,255,677

(注) 当初設定数量は5,434,717,619口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成29年2月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	2,630,086,835	25.26
内 日本	2,630,086,835	25.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,782,108,480	74.74
純資産総額	10,412,195,315	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

## (2) 投資資産（平成29年2月28日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	649 国庫短期証券	日本	国債証券	870,000,000	100.00 870,030,643	100.00 870,030,643	- 2017/03/13	8.36
2	648 国庫短期証券	日本	国債証券	800,000,000	100.00 800,012,980	100.00 800,012,980	- 2017/03/06	7.68
3	651 国庫短期証券	日本	国債証券	570,000,000	100.00 570,032,646	100.00 570,032,646	- 2017/03/21	5.47
4	631 国庫短期証券	日本	国債証券	390,000,000	100.00 390,010,566	100.00 390,010,566	- 2017/03/10	3.75

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	25.26%
合計	25.26%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## (参考情報) 運用実績

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース

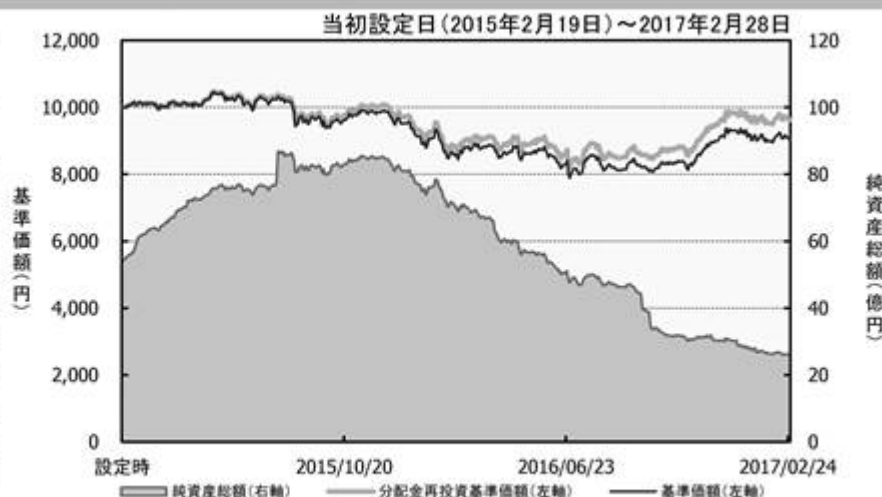
2017年2月28日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	9,048円
純資産総額	25億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	-0.0%
3か月間	2.7%
6か月間	10.4%
1年間	7.6%
3年間	-
5年間	-
設定来	-3.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。  
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 300円 設定来分配金合計額: 550円

決算期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期
	16年3月	16年4月	16年5月	16年6月	16年7月	16年8月	16年9月	16年10月	16年11月	16年12月	17年1月	17年2月
分配金	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

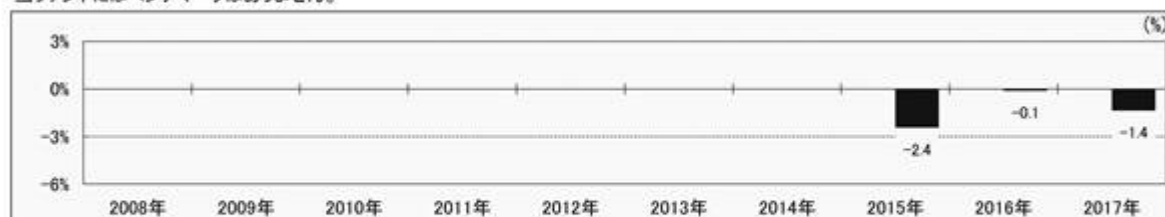
## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク	マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(ヘッジなし・クラス)	98.4%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0.2%
合計		98.7%

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。  
・2015年は設定日(2月19日)から年末、2017年は2月28日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型)日本円コース】



## (1) 【投資状況】（平成29年2月28日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	907,762,733	98.54
内 ケイマン諸島	907,762,733	98.54
親投資信託受益証券	1,399,500	0.15
内 日本	1,399,500	0.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,093,510	1.31
純資産総額	921,255,743	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

## (2) 【投資資産】（平成29年2月28日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND JPY HEDGED CLASS	ケイマン 諸島	投資信 託受益 証券	9,813,969.46	92.13 904,200,262	92.49 907,762,733	98.54
2	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,397,544	1.0014 1,399,500	1.0014 1,399,500	0.15

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.54%
親投資信託受益証券	0.15%
合計	98.69%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1特定期間末 (平成27年8月18日)	1,503,481,137	1,507,345,750	0.9726	0.9751
第2特定期間末 (平成28年2月18日)	1,370,057,871	1,373,848,174	0.9037	0.9062
平成28年2月末日	1,452,917,074	-	0.9120	-
3月末日	1,349,387,308	-	0.9322	-
4月末日	1,218,529,324	-	0.9404	-
5月末日	1,115,384,750	-	0.9432	-
6月末日	1,021,598,716	-	0.9356	-
7月末日	1,044,993,617	-	0.9545	-
第3特定期間末 (平成28年8月18日)	1,046,279,372	1,049,008,603	0.9584	0.9609
8月末日	1,039,962,901	-	0.9606	-
9月末日	1,002,621,183	-	0.9514	-
10月末日	979,647,218	-	0.9407	-
11月末日	947,477,956	-	0.9317	-
12月末日	942,555,433	-	0.9369	-
平成29年1月末日	957,858,081	-	0.9406	-
第4特定期間末 (平成29年2月20日)	944,998,577	947,488,564	0.9488	0.9513
2月末日	921,255,743	-	0.9522	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0100
第2特定期間	0.0150

第3特定期間	0.0150
第4特定期間	0.0150

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	1.7
第2特定期間	5.5
第3特定期間	7.7
第4特定期間	0.6

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	758,780,545	73,215,685
第2特定期間	35,493,559	65,217,763
第3特定期間	136,863,038	561,291,635
第4特定期間	38,436,656	134,134,492

(注) 当初設定数量は860,280,595口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コース

2017年2月28日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,522円
純資産総額	9.2億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.5%
3カ月間	3.0%
6カ月間	0.7%
1年間	7.8%
3年間	-
5年間	-
設定来	0.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。  
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

## 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額： 300円 設定来分配金合計額： 550円

決算期	第11期 16年3月	第12期 16年4月	第13期 16年5月	第14期 16年6月	第15期 16年7月	第16期 16年8月	第17期 16年9月	第18期 16年10月	第19期 16年11月	第20期 16年12月	第21期 17年1月	第22期 17年2月
分配金	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

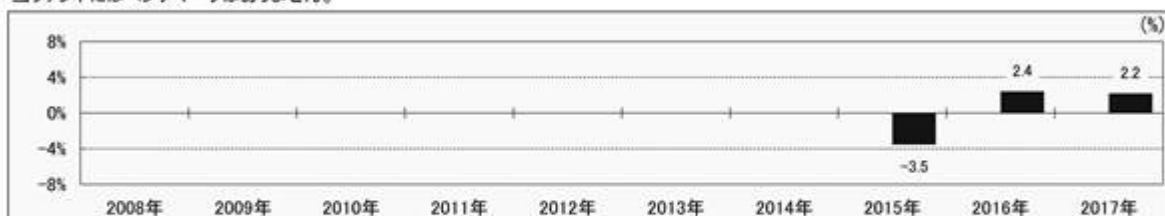
## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク/大和証券投資信託委託 大和証券投資信託委託	マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(円ヘッジ・クラス)	98.5%
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0.2%
合計		98.7%

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2015年は設定日(2月19日)から年末、2017年は2月28日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

## 【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース】

## (1) 【投資状況】（平成29年2月28日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	2,356,736,670	97.81
内 ケイマン諸島	2,356,736,670	97.81
親投資信託受益証券	3,999,599	0.17
内 日本	3,999,599	0.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	48,796,403	2.03
純資産総額	2,409,532,672	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

## (2) 【投資資産】（平成29年2月28日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND BRL CLASS	ケイマン諸島	投資信託受益証券	29,644,486.41	79.81 2,366,193,261	79.50 2,356,736,670	97.81
2	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,994,008	1.0014 3,999,599	1.0014 3,999,599	0.17

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	97.81%
親投資信託受益証券	0.17%
合計	97.97%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1特定期間末 (平成27年8月18日)	5,793,372,118	5,860,308,511	0.8655	0.8755
第2特定期間末 (平成28年2月18日)	4,098,607,614	4,162,893,121	0.6376	0.6476
平成28年2月末日	4,139,368,489	-	0.6436	-
3月末日	4,377,710,243	-	0.7169	-
4月末日	4,023,877,649	-	0.7250	-
5月末日	3,612,797,353	-	0.7020	-
6月末日	3,514,458,209	-	0.7268	-
7月末日	3,376,457,673	-	0.7449	-
第3特定期間末 (平成28年8月18日)	3,207,897,052	3,252,079,867	0.7261	0.7361
8月末日	3,232,859,173	-	0.7385	-
9月末日	2,991,475,661	-	0.7325	-
10月末日	2,981,971,040	-	0.7600	-
11月末日	2,756,308,639	-	0.7488	-
12月末日	2,921,539,245	-	0.8168	-
平成29年1月末日	2,674,628,460	-	0.8325	-
第4特定期間末 (平成29年2月20日)	2,441,960,336	2,471,219,976	0.8346	0.8446
2月末日	2,409,532,672	-	0.8313	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0400
第2特定期間	0.0600
第3特定期間	0.0600
第4特定期間	0.0600

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	9.5
第2特定期間	19.4
第3特定期間	23.3
第4特定期間	23.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	641,476,054	173,969,198
第2特定期間	158,569,290	423,657,918
第3特定期間	142,456,414	2,152,725,553
第4特定期間	173,557,263	1,665,874,758

(注) 当初設定数量は6,226,132,493口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型)為替ヘッジなしコース」の記載と同じ。

(参考情報) 運用実績

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター(毎月分配型)ブラジル・リアル・コース

2017年2月28日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。  
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

## 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額： 1,200円 設定来分配金合計額： 2,200円

決算期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期
	16年3月	16年4月	16年5月	16年6月	16年7月	16年8月	16年9月	16年10月	16年11月	16年12月	17年1月	17年2月
分配金	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円	100円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

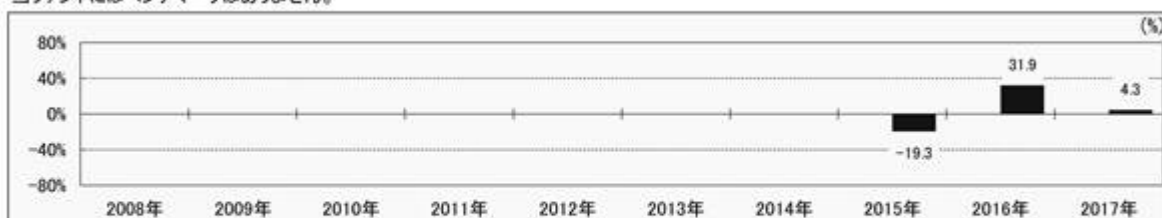
## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク/大和証券投資信託委託	マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(ブラジル・リアル・クラス)	97.8%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	0.2%
合計		98.0%

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2015年は設定日(2月19日)から年末、2017年は2月28日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

## 【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース】

## (1) 【投資状況】（平成29年2月28日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	903,835,552	98.77
内 ケイマン諸島	903,835,552	98.77
親投資信託受益証券	1,599,859	0.17
内 日本	1,599,859	0.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,624,136	1.05
純資産総額	915,059,547	100.00

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

## (2) 【投資資産】（平成29年2月28日現在）



## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND CURRENCY SELECTION CLASS	ケイマン 諸島	投資信 託受益 証券	12,922,274.28	69.70 900,734,206	69.94 903,835,552	98.77
2	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	1,597,623	1.0014 1,599,859	1.0014 1,599,859	0.17

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.77%
親投資信託受益証券	0.17%
合計	98.95%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)

第1特定期間末 (平成27年8月18日)	2,573,061,357	2,595,796,095	0.9054	0.9134
第2特定期間末 (平成28年2月18日)	1,882,787,519	1,904,173,822	0.7043	0.7123
平成28年2月末日	1,890,967,661	-	0.7113	-
3月末日	1,867,157,898	-	0.7466	-
4月末日	1,660,657,956	-	0.7483	-
5月末日	1,418,677,458	-	0.7185	-
6月末日	1,254,742,527	-	0.6875	-
7月末日	1,180,409,876	-	0.7054	-
第3特定期間末 (平成28年8月18日)	1,129,049,487	1,142,225,980	0.6855	0.6935
8月末日	1,143,772,168	-	0.6946	-
9月末日	1,056,233,695	-	0.6791	-
10月末日	1,036,914,817	-	0.6922	-
11月末日	948,072,183	-	0.6838	-
12月末日	944,622,557	-	0.7238	-
平成29年1月末日	907,455,935	-	0.7079	-
第4特定期間末 (平成29年2月20日)	912,497,353	922,673,504	0.7174	0.7254
2月末日	915,059,547	-	0.7196	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1特定期間	0.0320
第2特定期間	0.0480
第3特定期間	0.0480
第4特定期間	0.0480

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1特定期間	6.3
第2特定期間	16.9
第3特定期間	4.1
第4特定期間	11.7

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1特定期間	565,042,927	27,623,802
第2特定期間	55,126,249	223,680,694
第3特定期間	29,331,637	1,055,557,824
第4特定期間	14,984,808	390,027,534

(注) 当初設定数量は2,304,423,202口です。

## (参考) マザーファンド

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」の記載と同じ。

## (参考情報) 運用実績

## 通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース

2017年2月28日現在

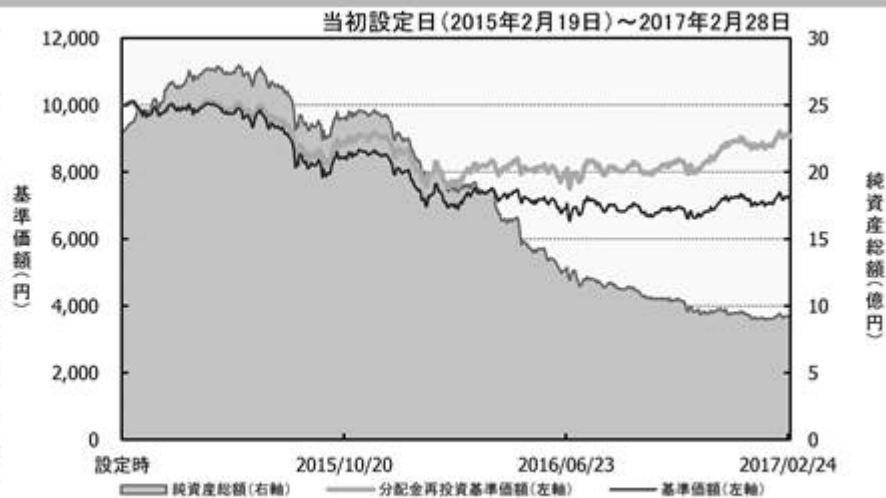
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	7,196円
純資産総額	9.1億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.8%
3カ月間	8.8%
6カ月間	11.0%
1年間	16.0%
3年間	-
5年間	-
設定来	-9.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。  
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

## 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額： 960円 設定来分配金合計額： 1,760円

決算期	第11期	第12期	第13期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期
	16年3月	16年4月	16年5月	16年6月	16年7月	16年8月	16年9月	16年10月	16年11月	16年12月	17年1月	17年2月
分配金	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円	80円

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

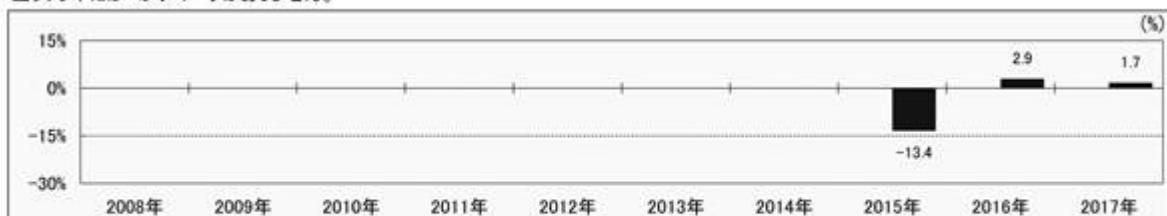
## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク/大和証券投資信託委託 大和証券投資信託委託	マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(通貨セレクト・クラス) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	98.8% 0.2%
合計		98.9%

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



\*ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

\*2015年は設定日(2月19日)から年末、2017年は2月28日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

ただし、販売会社は、次のイ・およびロ・に掲げる日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けは行ないません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日（当ファンドの運営および受益者に与える影響が軽微であるとして委託会社が定める日に限り除きます。）

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までには受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置をとった場合には、販売会社は、取得申込みの受け付けを中止することができるほか、すでに受付けた取得申込みを取消することができるものとします。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないません。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないません。

### 2 【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までには受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

#### <一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

ただし、販売会社は、次のイ・およびロ・に掲げる日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

イ．ニューヨーク証券取引所またはニューヨークの銀行のいずれかの休業日と同じ日付の日

ロ．前イ．のほか、一部解約金の支払い等に支障を来すおそれがあるとして委託会社が定める日

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

#### ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

#### ・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）」を構成する各ファンドの受益者が、当該ファンドの一部解約金の手取金をもって他の構成ファンドの受益権の取得申込みをする場合において、当該他の構成ファンドの受益権の取得申込みの受け付けが中止された場合、委託会社は、当該一部解約請求の申込みの受け付けを中止することができます。

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更および規制の導入、自然災害、クーデター、重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖または流動性の極端な減少ならびに資金の受渡しに関する障害等）が発生した場合には、一部解約請求の受け付けを中止することができます。

一部解約請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して6営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

##### （注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ 組入外国投資信託の受益証券：原則として計算時において知り得る直近の日の基準価額で評価します。
- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

##### （注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ 本邦通貨表示の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
  2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
  3. 価格情報会社の提供する価額

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせるにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・ お電話によるお問合わせ先（委託会社）
  - 電話番号（コールセンター） 0120-106212
  - （営業日の9:00～17:00）
- ・ 委託会社のホームページ
  - アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

平成27年2月19日から平成32年2月18日までとします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

委託会社は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託会社と合意のうえ、信託期間を延長することができます。

#### (4) 【計算期間】

毎月19日から翌月18日までとします。ただし、第1計算期間は、平成27年2月19日から平成27年5月18日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日には適用しません。

#### (5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、当ファンドが主要投資対象とする組入外国投資信託が存続しないこととなる場合には、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。
3. 委託会社は、前1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
4. 前3.の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本4.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、信託契約にかかる知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
5. 前3.の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
6. 前3.から前5.までの規定は、前2.の規定に基づいて信託契約を解約するとき、あるいは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.から前5.までの手続を行なうことが困難な場合も同じとします。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する



委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更等

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。なお、信託約款は本の1.から7.までに定める以外の方法によって変更することができないものとしします。
2. 委託会社は、前1.の事項(前1.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 前2.の書面決議において、受益者(委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本3.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、信託約款にかかる知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
5. 書面決議の効力は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前2.から前5.までの規定は、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前1.から前6.までの規定にかかわらず、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前7.までの規定にしたがいます。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

#### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書)を毎年2月および8月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。

2. 委託会社は、運用報告書(全体版)(投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書)を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合には、これを交付します。

#### 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月(または3か月)前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

## 4 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金(分配金額は、委託会社が決定します。)および償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。)を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

#### 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

### 第3 【ファンドの経理状況】

#### 【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成28年8月19日から平成29年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成28年8月18日現在	当 期 平成29年2月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	84,568,759	43,153,069
投資信託受益証券	4,592,427,345	2,585,597,692
親投資信託受益証券	6,000,998	5,998,602
流動資産合計	4,682,997,102	2,634,749,363
資産合計	4,682,997,102	2,634,749,363
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	14,312,607	7,166,454
未払解約金	12,110,207	23,779,884
未払受託者報酬	106,896	65,519
未払委託者報酬	4,703,713	2,883,171
その他未払費用	231,169	135,659
流動負債合計	31,464,592	34,030,687
負債合計	31,464,592	34,030,687
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 5,725,042,831	1 2,866,581,606
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,073,510,321	2 265,862,930
（分配準備積立金）	222,679,269	131,707,421
元本等合計	4,651,532,510	2,600,718,676
純資産合計	4,651,532,510	2,600,718,676
負債純資産合計	4,682,997,102	2,634,749,363

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成28年2月19日 至 平成28年8月18日		自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日	
営業収益				
受取配当金		176,942,114		91,904,764
受取利息		37		-
有価証券売買等損益		360,677,607		346,263,187
営業収益合計		183,735,456		438,167,951
営業費用				
支払利息		15,485		21,695
受託者報酬		770,775		452,445
委託者報酬		33,916,309		19,909,505
その他費用		232,350		135,659
営業費用合計		34,934,919		20,519,304
営業利益又は営業損失（ ）		218,670,375		417,648,647
経常利益又は経常損失（ ）		218,670,375		417,648,647
当期純利益又は当期純損失（ ）		218,670,375		417,648,647
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		5,725,480		24,392,295
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,109,579,235		1,073,510,321
剰余金増加額又は欠損金減少額		367,327,575		472,954,908
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		367,327,575		472,954,908
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,655,128		5,024,294
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,655,128		5,024,294
分配金		1 97,207,678		1 53,539,575
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,073,510,321		265,862,930

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成28年8月19日	至 平成29年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日</p> <p>平成29年2月18日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成29年2月20日としております。このため、当特定期間は186日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
1. 1 期首元本額	8,285,840,183円	5,725,042,831円
期中追加設定元本額	68,353,325円	37,794,452円
期中一部解約元本額	2,629,150,677円	2,896,255,677円

2.	特定期間末日における受益権の総数	5,725,042,831口	2,866,581,606口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,073,510,321円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は265,862,930円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成28年2月19日 至 平成28年8月18日	自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1 分配金の計算過程	<p>(自平成28年2月19日 至平成28年3月18日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(33,216,537円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(43,301,091円)及び分配準備積立金(241,676,945円)より分配対象額は318,194,573円(1万口当たり415.58円)であり、うち19,141,804円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年8月19日 至平成28年9月20日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(16,337,901円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(28,649,928円)及び分配準備積立金(185,662,774円)より分配対象額は230,650,603円(1万口当たり482.52円)であり、うち11,950,270円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>



(自平成28年3月19日 至平成28年4月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(26,044,687円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(39,642,483円)及び分配準備積立金(232,499,827円)より分配対象額は298,186,997円(1万口当たり427.95円)であり、うち17,419,359円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年4月19日 至平成28年5月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(23,490,157円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(38,064,523円)及び分配準備積立金(226,755,699円)より分配対象額は288,310,379円(1万口当たり438.77円)であり、うち16,427,101円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年9月21日 至平成28年10月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(14,839,640円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(22,946,659円)及び分配準備積立金(150,770,706円)より分配対象額は188,557,005円(1万口当たり496.60円)であり、うち9,492,358円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年10月19日 至平成28年11月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(14,228,749円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(22,040,543円)及び分配準備積立金(148,820,836円)より分配対象額は185,090,128円(1万口当たり510.88円)であり、うち9,057,503円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年5月19日 至平成28年6月20日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(18,829,618円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(35,594,618円)及び分配準備積立金(217,422,957円)より分配対象額は271,847,193円(1万口当たり444.57円)であり、うち15,287,233円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年6月21日 至平成28年7月19日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(25,947,710円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(34,547,746円)及び分配準備積立金(210,807,209円)より分配対象額は271,302,665円(1万口当たり463.94円)であり、うち14,619,574円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年11月19日 至平成28年12月19日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(12,257,456円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(20,291,208円)及び分配準備積立金(140,129,684円)より分配対象額は172,678,348円(1万口当たり523.02円)であり、うち8,253,951円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年12月20日 至平成29年1月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(10,133,019円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(18,836,576円)及び分配準備積立金(132,940,118円)より分配対象額は161,909,713円(1万口当たり531.27円)であり、うち7,619,039円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

	<p>（自平成28年7月20日 至平成28年8月18日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（19,684,417円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（33,986,118円）及び分配準備積立金（217,307,459円）より分配対象額は270,977,994円（1万口当たり473.32円）であり、うち14,312,607円（1万口当たり25円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年1月19日 至平成29年2月20日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（12,030,384円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（18,293,312円）及び分配準備積立金（126,843,491円）より分配対象額は157,167,187円（1万口当たり548.27円）であり、うち7,166,454円（1万口当たり25円）を分配金額としております。</p>
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	平成29年2月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	215,771,363	14,441,494
親投資信託受益証券	0	599
合計	215,771,363	14,440,895

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期	当 期
平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

当 期
自 平成28年8月19日
至 平成29年2月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	前 期 平成28年8月18日現在	当 期 平成29年2月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.8125円 (8,125円)	0.9073円 (9,073円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND NON-HEDGED CLASS	29,441,008.530	2,585,597,692	
投資信託受益証券 合計			2,585,597,692	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	5,990,216	5,998,602	
親投資信託受益証券 合計			5,998,602	
合計			2,591,596,294	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(ヘッジなし・クラス)」の受益証券(円建)を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・プレミアム・トラスト・マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド(ヘッジなし・クラス)」の状況

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(米ドル建て)

貸借対照表  
2016年7月29日

<b>資産</b>		
投資資産の公正価値(簿価 \$61,356,293)	\$	62,443,637
利害関係人への投資(簿価 \$36,215,625)		37,405,829
現金		3,379
外国通貨の公正価値(簿価 \$1,003)		7,313
為替先渡契約による評価益		792,390
スワップ契約による評価益		6,289
先物取引に係る未収変動証拠金		587,218
未収:		
売却した利害関係人への投資		2,038,641
売却済みの投資		1,895,453
受益証券の発行		204,908
利息		149,981
配当		33,387
決済済み為替先渡契約		11,322
利害関係人からの配当金		6,094
前払受託会社報酬		6,359
<b>資産合計</b>		<b>105,592,200</b>
<b>負債</b>		
為替先渡契約による評価損		107,521
スワップ契約による評価損		10,828
受取スワップ・プレミアム		389,238

未払：

購入済みの投資	1,940,047
投資運用会社報酬	613,460
償還済み受益証券	487,876
保管会社報酬	110,735
専門家報酬	53,045
会計および管理会社報酬	13,126
名義書換代理人報酬	4,245
買付けた利害関係人への投資	4,202
為替運用会社報酬	2,522
<b>負債合計</b>	<b>3,736,845</b>

**純資産** **\$ 101,855,355**

<b>純資産</b>	
ブラジル・レアル・クラス	\$ 31,932,448
通貨セレクト・クラス	11,156,557
円ヘッジ・クラス	10,974,259
ヘッジなし・クラス	47,792,091
	<b>\$ 101,855,355</b>

<b>発行済み受益証券</b>	
ブラジル・レアル・クラス	46,270,328
通貨セレクト・クラス	17,118,561
円ヘッジ・クラス	12,053,933
ヘッジなし・クラス	60,821,323

<b>受益証券1口当り純資産</b>	
ブラジル・レアル・クラス	\$ 0.690
通貨セレクト・クラス	\$ 0.652
円ヘッジ・クラス	\$ 0.910
ヘッジなし・クラス	\$ 0.786

**損益計算書**  
2016年7月29日に終了する年度

<b>投資収益</b>	
受取利息 (\$73,668の源泉徴収税控除後)	\$ 2,933,059
配当収益 (\$228,744の源泉徴収税控除後)	3,230,015
利害関係人への投資からの受取配当金 (\$261,097の源泉徴収税控除後)	790,320
<b>投資収益合計</b>	<b>6,953,394</b>

<b>費用</b>	
投資運用会社報酬	851,925
保管会社報酬	672,936
会計および管理会社報酬	95,530
専門家報酬	71,437
為替運用会社報酬	39,915
名義書換代理人報酬	26,850
受託会社報酬	15,907
登録料	3,455
<b>費用合計</b>	<b>1,777,955</b>

**投資純利益** **5,175,439**

**実現益（損）および評価益（損）：****実現益（損）：**

証券投資	(6,431,831)
利害関係人への投資	(1,017,342)
先物取引	(370,850)
スワップ契約	150,435
外国為替取引および外国為替先渡契約	2,148,911

**純実現損失**

(5,520,677)

**評価益（損）の純変動：**

証券投資	2,092,932
利害関係人への投資	1,804,258
スワップ契約	1,472
先物取引	21,855
外国為替換算および外国為替先渡契約	4,741,487

**評価益の純変動**

8,662,004

**純実現・純評価益**

3,141,327

**運用による純資産の純増**

\$ 8,316,766

**（投資明細表）**

投資明細表に記載の有価証券はすべて、その証券の所在地よりもカントリーリスクがどこにあるかについて経営陣が最善の評価を行い分類しています。

(a) コーラブル債

(b) 2016年7月29日現在の変動利付証券

(c) 永久債

(d) 144A証券 - 1933年証券法の規則144Aのもと登録が免除されている証券。同証券は、登録が免除されている取引によって転売できます。取引の買い手は通常は適格機関投資家。別段の記載がない限り、同証券は非流動資産とみなされません。

(e) デフォルト証券

(f) 運用会社の利害関係人

**2016年7月29日現在の先物建玉（純資産の-0.2%）**

ポジション	銘柄	決済日	契約枚数	純評価益/(損)
売り	British Pound Currency Futures	2016年9月	(28)	\$ 229,955
売り	Euro FX Currency Futures	2016年9月	(14)	14,554
売り	FTSE 100 IDX Futures	2016年9月	(5)	(49,600)
買い	MSCI EM Futures	2016年9月	23	82,800
売り	S&P 500 E-Mini Futures	2016年9月	(51)	(299,862)
売り	U.S. Long Bond Futures	2016年9月	(6)	(15,999)
買い	U.S. Treasury 2-Year Note Futures	2016年9月	3	1,187
売り	U.S. Treasury 5-Year Note Futures	2016年9月	(26)	2,747
売り	U.S. Treasury 10-Year Note Futures	2016年9月	(63)	(79,719)
売り	U.S. Ultra Bond Futures	2016年9月	(10)	(40,125)
				<b>\$ (154,062)</b>

**2016年7月29日現在のクレジット・デフォルト・スワップ残高（純資産の-0.0%）**



参照事業体	信用 プロ テク ション	受取 (支払)	満期日	カウンターパーティ	信用格付	通貨	想定元本	評価額	プレミアム	評価益/(損)
CMBX.NA.7.BBB-	売り	3.00%	2047年1月17日	Credit Suisse International	BBB-	USD	800,000	\$ (55,256)	\$ (44,428)	\$ (10,828)
CMBX.NA.9.BBB-	売り	3.00%	2058年9月17日	Credit Suisse International	BBB-	USD	2,000,000	(338,521)	(344,810)	6,289
								\$ (393,777)	\$ (389,238)	\$ (4,539)

## 2016年7月29日現在のファンドレベルの為替先渡契約残高(純資産の-0.0%)

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
USD	Morgan Stanley	388,885	2016年8月3日	EUR	350,000	\$ -	\$ (2,517)	\$ (2,517)
USD	Royal Bank of Scotland PLC	389,725	2016年9月6日	EUR	350,000	-	(2,219)	(2,219)
						\$ -	\$ (4,736)	\$ (4,736)

## 2016年7月29日現在のブラジル・レアル・クラスの為替先渡契約残高(純資産の0.6%)

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
BRL	Citibank N.A.	2,599,483	2016年8月10日	GBP	598,577	\$ 7,251	\$ -	\$ 7,251
BRL	Citibank N.A.	98,112,645	2016年8月10日	USD	29,704,090	569,000	-	569,000
BRL	Citibank N.A.	1,345,420	2016年8月10日	CHF	396,763	4,420	-	4,420
BRL	Citibank N.A.	2,081,399	2016年8月10日	EUR	570,245	4,339	-	4,339
						\$ 585,010	\$ -	\$ 585,010

## 2016年7月29日現在の通貨セレクト・クラスの為替先渡契約残高(純資産の-0.0%)

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
BRL	Citibank N.A.	171,854	2016年8月10日	GBP	39,605	\$ 436	\$ -	\$ 436
BRL	Citibank N.A.	6,491,350	2016年8月10日	USD	1,965,346	37,588	-	37,588
BRL	Citibank N.A.	89,035	2016年8月10日	CHF	26,253	296	-	296
BRL	Citibank N.A.	137,706	2016年8月10日	EUR	37,731	283	-	283
CLP	Citibank N.A.	25,619,464	2016年8月10日	GBP	29,587	-	(165)	(165)
CLP	Citibank N.A.	966,183,627	2016年8月10日	USD	1,469,136	6,260	-	6,260
CLP	Citibank N.A.	13,317,393	2016年8月10日	CHF	19,592	55	-	55
CLP	Citibank N.A.	20,438,868	2016年8月10日	EUR	28,224	-	(361)	(361)
IDR	Citibank N.A.	629,521,847	2016年8月10日	GBP	36,369	-	(281)	(281)
IDR	Citibank N.A.	23,728,125,542	2016年8月10日	USD	1,803,746	5,862	-	5,862
IDR	Citibank N.A.	325,814,101	2016年8月10日	CHF	24,130	-	(130)	(130)
IDR	Citibank N.A.	503,279,209	2016年8月10日	EUR	34,606	-	(327)	(327)
INR	Citibank N.A.	3,295,016	2016年8月10日	GBP	37,191	-	(260)	(260)
INR	Citibank N.A.	124,233,177	2016年8月10日	USD	1,844,791	7,325	-	7,325
INR	Citibank N.A.	1,704,598	2016年8月10日	CHF	24,669	-	(123)	(123)
INR	Citibank N.A.	2,635,292	2016年8月10日	EUR	35,400	-	(310)	(310)
MXN	Citibank N.A.	670,778	2016年8月10日	GBP	27,904	-	(1,283)	(1,283)
MXN	Citibank N.A.	25,426,781	2016年8月10日	USD	1,385,256	-	(29,385)	(29,385)
MXN	Citibank N.A.	343,297	2016年8月10日	CHF	18,484	-	(828)	(828)
MXN	Citibank N.A.	543,054	2016年8月10日	EUR	26,607	-	(804)	(804)
TRY	Citibank N.A.	152,156	2016年8月10日	GBP	40,569	-	(3,084)	(3,084)
TRY	Citibank N.A.	5,844,850	2016年8月10日	USD	2,009,966	-	(59,010)	(59,010)
TRY	Citibank N.A.	76,181	2016年8月10日	CHF	26,963	-	(2,485)	(2,485)
TRY	Citibank N.A.	126,651	2016年8月10日	EUR	38,516	-	(808)	(808)
						\$ 58,105	\$ (99,644)	\$ (41,539)

## 2016年7月29日現在の円ヘッジ・クラスの為替先渡契約残高(純資産の0.1%)

買い	カウンターパーティ	契約金額	決済日	売り	契約金額	評価益	評価(損)	純評価益/(損)
JPY	Citibank N.A.	27,275,778	2016年8月10日	GBP	201,127	\$ -	\$ (857)	\$ (857)
JPY	Citibank N.A.	1,037,178,315	2016年8月10日	USD	9,975,706	146,899	-	146,899

JPY	Citibank N.A.	13,917,535	2016年8月10日	CHF	133,427	-	(2,284)	(2,284)			
JPY	Citibank N.A.	22,176,885	2016年8月10日	EUR	191,372	2,376	-	2,376			
						\$	149,275	\$	(3,141)	\$	146,134

## 通貨の略称：

AUD	-	豪ドル
BRL	-	ブラジル・レアル
CAD		カナダ・ドル
CHF	-	スイス・フラン
CLP		チリ・ペソ
EUR	-	ユーロ
GBP	-	英ポンド
HKD		香港ドル
IDR	-	インドネシア・ルピア
INR		インド・ルピー
JPY	-	日本円
MXN	-	メキシコペソ
NOK		ノルウェー・クローネ
SEK		スウェーデン・クローネ
SGD		シンガポール・ドル
TRY	-	トルコリラ
USD	-	米ドル

## 「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
	金額(円)	金額(円)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	7,352,919,875	8,962,266,207
国債証券	4,960,519,051	1,450,065,916
未収利息	1,365,040	-
流動資産合計	12,314,803,966	10,412,332,123
資産合計	12,314,803,966	10,412,332,123
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	1,910,036,200	-
流動負債合計	1,910,036,200	-
負債合計	1,910,036,200	-

純資産の部		
元本等		
元本	1	10,386,493,229
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		18,274,537
元本等合計		10,404,767,766
純資産合計		10,404,767,766
負債純資産合計		12,314,803,966

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
1. 1 期首	平成28年2月19日	平成28年8月19日
期首元本額	11,320,284,828円	10,386,493,229円
期中追加設定元本額	23,802,454円	1,698,384,201円
期中一部解約元本額	957,594,053円	1,687,476,874円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンド（為替ヘッジあり）	999円	999円

ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジあり)	999円	999円
ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジなし)	999円	999円
通貨選択型ダイワ米国株主還 元株 クワトロプレミアム (毎月分配型)	219,583円	219,583円
通貨選択型ダイワ米国株主還 元株 クワトロプレミアム (年2回決算型)	24,953円	24,953円
ダイワ米国株主還元株ツイン プレミアム(毎月分配型)	848,389円	848,389円
ダイワ米国株主還元株ツイン プレミアム(年2回決算 型)	66,873円	66,873円
ダイワ米国株主還元株ファン ド	36,730,213円	36,730,213円
ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型)	4,995円	4,995円
ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型)	4,995円	4,995円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-04(為替ヘッジあ り/限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-07(為替ヘッジあ り/限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2014-10(為替ヘッジあ り/限定追加型)	999円	999円
世界ハイブリッド証券ファン ド2015-01(為替ヘッジあ り/限定追加型)	999円	999円
ダイワ・ブラジル・リアル債 (毎月分配型) - スー パー・ハイインカム - 50 コース	49,911円	49,911円

ダイワ・ブラジル・リアル債 (毎月分配型) - スー パー・ハイインカム - 100 コース	49,911円	49,911円
ダイワ・オーストラリア高配 当株ファンド・マネー・ポー トフォリオ	39,482,221円	40,335,759円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver3 -	1,128,222,690円	1,078,302,562円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver7 -	- 円	1,188,092,062円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド - シフト11 Ver5 -	2,095,808,384円	2,095,808,384円
ダイワ・スイス高配当株ツイ ン (毎月分配型)	2,996,106円	2,996,106円
通貨選択型ダイワ世界インカ ム・ハンター (毎月分配型) 為替ヘッジなしコース	5,990,216円	5,990,216円
通貨選択型ダイワ世界インカ ム・ハンター (毎月分配型) 日本円コース	1,397,544円	1,397,544円
通貨選択型ダイワ世界インカ ム・ハンター (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース	3,994,008円	3,994,008円
通貨選択型ダイワ世界インカ ム・ハンター (毎月分配型) 通貨セレクト・コース	1,597,623円	1,597,623円
ダイワ世界インカム・ハン ター (年2回決算型) 為替 ヘッジあり	40,885円	40,885円
ダイワ世界インカム・ハン ター (年2回決算型) 為替 ヘッジなし	100,789円	100,789円
ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジあり (毎月分配型)	29,988,005円	22,499,238円
ダイワ/NB・米国債券戦略 ファンド 為替ヘッジなし (毎月分配型)	1,999,201円	1,999,201円

通貨選択型 ダイワ/NB・ 米国債券戦略ファンド 日本 円コース（毎月分配型）	1,002,195円	502,943円
通貨選択型 ダイワ/NB・ 米国債券戦略ファンド 通貨 セレクトコース（毎月分配 型）	3,011,774円	1,014,769円
ダイワ新興国ハイインカム・ プラス - インカムチェンジ （積立型） -	1,527,685円	1,527,685円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド（限定追加型） - シフト11 -	3,536,610,361円	3,536,610,361円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド（限定追加型） - シフト12 -	2,207,003,670円	1,088,870,549円
ダイワ日本株式インデック ス・ファンド（限定追加型） - シフト13 -	1,287,713,056円	1,287,713,056円
計	10,386,493,229円	10,397,400,556円
2. 期末日における受益権の総数	10,386,493,229口	10,397,400,556口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年2月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	2,423,589	23,514
合計	2,423,589	23,514

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成27年12月10日から平成28年8月18日まで、及び平成28年12月10日から平成29年2月20日まで）を指しております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
1口当たり純資産額	1.0018円	1.0014円
（1万口当たり純資産額）	（10,018円）	（10,014円）

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	6 3 1 国庫短期証券	390,000,000	390,019,014	
	6 4 8 国庫短期証券	700,000,000	700,026,460	
	6 4 9 国庫短期証券	360,000,000	360,020,442	
国債証券 合計			1,450,065,916	
合計			1,450,065,916	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



**【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コース】**

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成28年8月19日から平成29年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コース

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成28年8月18日現在	当 期 平成29年2月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	19,173,969	12,982,230
投資信託受益証券	1,032,527,170	904,200,262
親投資信託受益証券	1,400,059	1,399,500
未収入金	-	33,000,000
流動資産合計	1,053,101,198	951,581,992
資産合計	1,053,101,198	951,581,992
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	2,729,231	2,489,987
未払解約金	3,004,276	3,000,041
未払受託者報酬	23,111	23,393
未払委託者報酬	1,017,163	1,029,798
その他未払費用	48,045	40,196
流動負債合計	6,821,826	6,583,415
負債合計	6,821,826	6,583,415
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 1,091,692,654	1 995,994,818
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 45,413,282	2 50,996,241
（分配準備積立金）	24,606,401	27,069,433
元本等合計	1,046,279,372	944,998,577
純資産合計	1,046,279,372	944,998,577
負債純資産合計	1,053,101,198	951,581,992

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成28年2月19日 至 平成28年8月18日		自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日	
営業収益				
受取配当金		33,727,990		25,432,444
受取利息		8		-
有価証券売買等損益		67,407,589		14,759,911
営業収益合計		101,135,587		10,672,533
営業費用				
支払利息		4,832		3,945
受託者報酬		160,400		134,230
委託者報酬		7,059,588		5,908,431
その他費用		48,463		40,196
営業費用合計		7,273,283		6,086,802
営業利益		93,862,304		4,585,731
経常利益		93,862,304		4,585,731
当期純利益		93,862,304		4,585,731
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		3,178,774		105,597
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		146,063,380		45,413,282
剰余金増加額又は欠損金減少額		39,894,599		7,613,915
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		39,894,599		7,613,915
剰余金減少額又は欠損金増加額		11,351,079		2,323,234
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		11,351,079		2,323,234
分配金		1 18,576,952		1 15,353,774
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		45,413,282		50,996,241

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成28年8月19日	至 平成29年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日</p> <p>平成29年2月18日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成29年2月20日としております。このため、当特定期間は186日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
1. 1 期首元本額	1,516,121,251円	1,091,692,654円
期中追加設定元本額	136,863,038円	38,436,656円
期中一部解約元本額	561,291,635円	134,134,492円

2.	特定期間末日における受益権の総数	1,091,692,654口	995,994,818口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は45,413,282円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は50,996,241円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成28年2月19日 至 平成28年8月18日	自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1 分配金の計算過程	<p>(自平成28年2月19日 至平成28年3月18日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(6,563,700円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,431,909円)及び分配準備積立金(22,661,461円)より分配対象額は33,657,070円(1万口当たり222.05円)であり、うち3,789,310円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年8月19日 至平成28年9月20日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,292,585円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,908,049円)及び分配準備積立金(23,951,624円)より分配対象額は31,152,258円(1万口当たり292.98円)であり、うち2,658,244円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>

(自平成28年3月19日 至平成28年4月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(5,452,334円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,110,941円)及び分配準備積立金(23,480,433円)より分配対象額は33,043,708円(1万口当たり235.99円)であり、うち3,500,500円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年4月19日 至平成28年5月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,280,030円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,637,056円)及び分配準備積立金(22,385,174円)より分配対象額は30,302,260円(1万口当たり245.70円)であり、うち3,083,269円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年9月21日 至平成28年10月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,516,235円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,894,222円)及び分配準備積立金(24,285,136円)より分配対象額は31,695,593円(1万口当たり301.44円)であり、うち2,628,707円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年10月19日 至平成28年11月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,315,609円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,803,419円)及び分配準備積立金(24,291,404円)より分配対象額は31,410,432円(1万口当たり309.06円)であり、うち2,540,795円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年5月19日 至平成28年6月20日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,310,843円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,464,254円)及び分配準備積立金(20,908,662円)より分配対象額は27,683,759円(1万口当たり250.98円)であり、うち2,757,606円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年6月21日 至平成28年7月19日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,881,524円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,488,717円)及び分配準備積立金(21,081,561円)より分配対象額は29,451,802円(1万口当たり270.99円)であり、うち2,717,036円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年11月19日 至平成28年12月19日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,611,253円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,740,318円)及び分配準備積立金(24,525,397円)より分配対象額は31,876,968円(1万口当たり320.35円)であり、うち2,487,645円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年12月20日 至平成29年1月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,544,521円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,656,772円)及び分配準備積立金(25,489,985円)より分配対象額は33,691,278円(1万口当たり330.51円)であり、うち2,548,396円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

	<p>（自平成28年7月20日 至平成28年8月18日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,478,095円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,997,249円）及び分配準備積立金（22,857,537円）より分配対象額は31,332,881円（1万口当たり287.01円）であり、うち2,729,231円（1万口当たり25円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年1月19日 至平成29年2月20日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,771,630円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,641,464円）及び分配準備積立金（25,787,790円）より分配対象額は34,200,884円（1万口当たり343.38円）であり、うち2,489,987円（1万口当たり25円）を分配金額としております。</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。



4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	平成29年2月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	6,383,304	6,789,614
親投資信託受益証券	0	140
合計	6,383,304	6,789,474

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期	当 期
平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

当 期
自 平成28年8月19日
至 平成29年2月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	前 期 平成28年8月18日現在	当 期 平成29年2月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9584円 (9,584円)	0.9488円 (9,488円)

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND JPY HEDGED CLASS	9,813,969.460	904,200,262	
投資信託受益証券 合計			904,200,262	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,397,544	1,399,500	
親投資信託受益証券 合計			1,399,500	
合計			905,599,762	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考）

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」の受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（円ヘッジ・クラス）」の状況

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の状況

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」に記載のとおりであります。

【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成28年8月19日から平成29年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けておりません。

## 1【財務諸表】

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成28年8月18日現在	当 期 平成29年2月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	117,178,873	65,940,735
投資信託受益証券	3,161,029,454	2,415,430,207
親投資信託受益証券	4,001,197	3,999,599
流動資産合計	3,282,209,524	2,485,370,541
資産合計	3,282,209,524	2,485,370,541
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	44,182,815	29,259,640
未払解約金	26,610,509	11,204,813
未払受託者報酬	74,804	62,824
未払委託者報酬	3,291,836	2,764,739
その他未払費用	152,508	118,189
流動負債合計	74,312,472	43,410,205
負債合計	74,312,472	43,410,205
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 4,418,281,582	1 2,925,964,087
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 1,210,384,530	2 484,003,751
（分配準備積立金）	163,299,646	109,414,125
元本等合計	3,207,897,052	2,441,960,336
純資産合計	3,207,897,052	2,441,960,336
負債純資産合計	3,282,209,524	2,485,370,541

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成28年2月19日 至 平成28年8月18日		自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日	
営業収益				
受取配当金		322,505,387		240,214,961
受取利息		20		-
有価証券売買等損益		545,615,332		384,184,194
営業収益合計		868,120,739		624,399,155
営業費用				
支払利息		11,685		15,300
受託者報酬		508,594		394,212
委託者報酬		22,380,395		17,347,658
その他費用		153,621		118,189
営業費用合計		23,054,295		17,875,359
営業利益		845,066,444		606,523,796
経常利益		845,066,444		606,523,796
当期純利益		845,066,444		606,523,796
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		19,605,323		31,062,110
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		2,329,943,107		1,210,384,530
剰余金増加額又は欠損金減少額		646,481,651		409,356,449
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		646,481,651		409,356,449
剰余金減少額又は欠損金増加額		42,898,211		42,497,126
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		42,898,211		42,497,126
分配金		1 309,485,984		1 215,940,230
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,210,384,530		484,003,751

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成28年8月19日	至 平成29年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日</p> <p>平成29年2月18日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成29年2月20日としております。このため、当特定期間は186日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
1. 1 期首元本額	6,428,550,721円	4,418,281,582円
期中追加設定元本額	142,456,414円	173,557,263円
期中一部解約元本額	2,152,725,553円	1,665,874,758円

2.	特定期間末日における受益権の総数	4,418,281,582口	2,925,964,087口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,210,384,530円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は484,003,751円であります。

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	前 期	当 期
	自 平成28年2月19日 至 平成28年8月18日	自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1 分配金の計算過程	<p>（自平成28年2月19日 至平成28年3月18日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（64,187,199円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（12,973,639円）及び分配準備積立金（246,268,134円）より分配対象額は323,428,972円（1万口当たり521.23円）であり、うち62,051,335円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成28年8月19日 至平成28年9月20日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（41,835,798円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（12,810,748円）及び分配準備積立金（151,864,995円）より分配対象額は206,511,541円（1万口当たり500.91円）であり、うち41,227,375円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>



(自平成28年3月19日 至平成28年4月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(50,280,071円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(12,999,858円)及び分配準備積立金(222,724,418円)より分配対象額は286,004,347円(1万口当たり511.08円)であり、うち55,960,679円(1万口当たり100円)を分配金額としております。

(自平成28年4月19日 至平成28年5月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(51,492,062円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(13,584,284円)及び分配準備積立金(202,549,266円)より分配対象額は267,625,612円(1万口当たり509.13円)であり、うち52,565,301円(1万口当たり100円)を分配金額としております。

(自平成28年9月21日 至平成28年10月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(41,104,202円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(16,048,192円)及び分配準備積立金(143,000,447円)より分配対象額は200,152,841円(1万口当たり506.82円)であり、うち39,491,800円(1万口当たり100円)を分配金額としております。

(自平成28年10月19日 至平成28年11月18日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(36,477,596円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(15,612,147円)及び分配準備積立金(134,407,662円)より分配対象額は186,497,405円(1万口当たり505.74円)であり、うち36,875,887円(1万口当たり100円)を分配金額としております。

（自平成28年5月19日 至平成28年6月20日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（45,417,138円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（13,388,231円）及び分配準備積立金（185,169,393円）より分配対象額は243,974,762円（1万口当たり502.74円）であり、うち48,529,349円（1万口当たり100円）を分配金額としております。

（自平成28年6月21日 至平成28年7月19日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（45,649,072円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（13,270,548円）及び分配準備積立金（172,781,001円）より分配対象額は231,700,621円（1万口当たり501.55円）であり、うち46,196,505円（1万口当たり100円）を分配金額としております。

（自平成28年11月19日 至平成28年12月19日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（37,287,303円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（15,995,283円）及び分配準備積立金（129,312,227円）より分配対象額は182,594,813円（1万口当たり510.16円）であり、うち35,791,955円（1万口当たり100円）を分配金額としております。

（自平成28年12月20日 至平成29年1月18日）

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（32,770,131円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（15,289,535円）及び分配準備積立金（121,283,458円）より分配対象額は169,343,124円（1万口当たり508.64円）であり、うち33,293,573円（1万口当たり100円）を分配金額としております。

	<p>（自平成28年7月20日 至平成28年8月18日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（43,239,183円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（13,176,016円）及び分配準備積立金（164,243,278円）より分配対象額は220,658,477円（1万口当たり499.42円）であり、うち44,182,815円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年1月19日 至平成29年2月20日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（33,345,506円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（14,365,913円）及び分配準備積立金（105,328,259円）より分配対象額は153,039,678円（1万口当たり523.04円）であり、うち29,259,640円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	平成29年2月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	平成28年8月18日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	平成29年2月20日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	91,432,641	99,290,820
親投資信託受益証券	0	400
合計	91,432,641	99,290,420

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期	当 期
平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

当 期
自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前 期 平成28年8月18日現在	当 期 平成29年2月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.7261円 (7,261円)	0.8346円 (8,346円)

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND BRL CLASS	30,261,343.890	2,415,430,207	
投資信託受益証券 合計			2,415,430,207	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	3,994,008	3,999,599	
親投資信託受益証券 合計			3,999,599	
合計			2,419,429,806	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

##### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

##### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」の受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（ブラジル・リアル・クラス）」の状況

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の状況

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」に記載のとおりであります。

【通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成28年8月19日から平成29年2月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けておりません。

## 1【財務諸表】

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	前 期 平成28年8月18日現在	当 期 平成29年2月20日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	18,906,223	23,576,310
投資信託受益証券	1,109,978,627	900,734,206
親投資信託受益証券	1,600,498	1,599,859
未収入金	15,000,000	-
流動資産合計	1,145,485,348	925,910,375
資産合計	1,145,485,348	925,910,375
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	13,176,493	10,176,151
未払解約金	2,027,993	2,194,800
未払受託者報酬	26,016	22,237
未払委託者報酬	1,144,844	978,770
その他未払費用	60,515	41,064
流動負債合計	16,435,861	13,413,022
負債合計	16,435,861	13,413,022
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 1,647,061,695	1 1,272,018,969
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 518,012,208	2 359,521,616
（分配準備積立金）	55,144,628	34,744,012
元本等合計	1,129,049,487	912,497,353
純資産合計	1,129,049,487	912,497,353
負債純資産合計	1,145,485,348	925,910,375



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成28年2月19日 至 平成28年8月18日		自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日	
営業収益				
受取配当金		100,228,983		63,815,867
受取利息		10		-
有価証券売買等損益		11,138,910		52,939,073
営業収益合計		89,090,083		116,754,940
営業費用				
支払利息		5,421		4,692
受託者報酬		201,992		137,172
委託者報酬		8,889,307		6,037,266
その他費用		60,834		41,064
営業費用合計		9,157,554		6,220,194
営業利益		79,932,529		110,534,746
経常利益		79,932,529		110,534,746
当期純利益		79,932,529		110,534,746
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		4,808,374		5,782,694
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		790,500,363		518,012,208
剰余金増加額又は欠損金減少額		301,250,116		125,369,784
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		301,250,116		125,369,784
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,338,261		4,695,494
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,338,261		4,695,494
分配金		1 95,547,855		1 66,935,750
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		518,012,208		359,521,616

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成28年8月19日	至 平成29年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>	
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。</p>	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日</p> <p>平成29年2月18日及びその翌日が休日のため、当特定期間末日を平成29年2月20日としております。このため、当特定期間は186日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
1. 1 期首元本額	2,673,287,882円	1,647,061,695円
期中追加設定元本額	29,331,637円	14,984,808円
期中一部解約元本額	1,055,557,824円	390,027,534円

2.	特定期間末日における受益権の総数	1,647,061,695口	1,272,018,969口
3.	2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は518,012,208円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は359,521,616円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成28年2月19日 至 平成28年8月18日	自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1 分配金の計算過程	<p>(自平成28年2月19日 至平成28年3月18日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(22,538,894円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,685,747円)及び分配準備積立金(95,007,385円)より分配対象額は122,232,026円(1万口当たり481.90円)であり、うち20,291,474円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年8月19日 至平成28年9月20日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,791,179円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,645,888円)及び分配準備積立金(52,808,018円)より分配対象額は66,245,085円(1万口当たり419.33円)であり、うち12,638,400円(1万口当たり80円)を分配金額としております。</p>

(自平成28年3月19日 至平成28年4月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(16,931,155円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,414,619円)及び分配準備積立金(85,826,850円)より分配対象額は107,172,624円(1万口当たり477.31円)であり、うち17,962,664円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自平成28年4月19日 至平成28年5月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(14,269,041円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,188,140円)及び分配準備積立金(75,384,061円)より分配対象額は93,841,242円(1万口当たり468.66円)であり、うち16,018,480円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自平成28年9月21日 至平成28年10月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(11,178,721円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,562,884円)及び分配準備積立金(47,715,481円)より分配対象額は62,457,086円(1万口当たり413.30円)であり、うち12,089,439円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自平成28年10月19日 至平成28年11月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,144,430円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,380,893円)及び分配準備積立金(43,410,752円)より分配対象額は55,936,075円(1万口当たり398.44円)であり、うち11,231,100円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自平成28年5月19日 至平成28年6月20日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(12,723,098円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,946,670円)及び分配準備積立金(67,482,639円)より分配対象額は84,152,407円(1万口当たり457.90円)であり、うち14,702,447円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自平成28年6月21日 至平成28年7月19日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(12,544,063円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,686,379円)及び分配準備積立金(59,593,993円)より分配対象額は75,824,435円(1万口当たり452.81円)であり、うち13,396,297円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自平成28年11月19日 至平成28年12月19日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(9,574,984円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,213,740円)及び分配準備積立金(38,366,169円)より分配対象額は51,154,893円(1万口当たり391.77円)であり、うち10,445,987円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

(自平成28年12月20日 至平成29年1月18日)  
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,880,504円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,256,909円)及び分配準備積立金(37,097,271円)より分配対象額は49,234,684円(1万口当たり380.39円)であり、うち10,354,673円(1万口当たり80円)を分配金額としております。

	<p>（自平成28年7月20日 至平成28年8月18日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（10,629,895円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,712,770円）及び分配準備積立金（57,691,226円）より分配対象額は72,033,891円（1万口当たり437.35円）であり、うち13,176,493円（1万口当たり80円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年1月19日 至平成29年2月20日）</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（9,976,384円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,265,980円）及び分配準備積立金（34,943,779円）より分配対象額は48,186,143円（1万口当たり378.82円）であり、うち10,176,151円（1万口当たり80円）を分配金額としております。</p>
--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、投資信託受益証券及び親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期
	平成29年2月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	前 期	当 期
	平成28年8月18日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	平成29年2月20日現在 最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	49,935,691	24,660,918
親投資信託受益証券	0	160
合計	49,935,691	24,660,758

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期	当 期
平成28年8月18日現在	平成29年2月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

当 期
自 平成28年8月19日 至 平成29年2月20日

市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前 期 平成28年8月18日現在	当 期 平成29年2月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6855円 (6,855円)	0.7174円 (7,174円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資信託受益証券	MULTI-ASSET INCOME ALLOCATION FUND CURRENCY SELECTION CLASS	12,922,274.280	900,734,206	
投資信託受益証券 合計			900,734,206	
親投資信託受益証券	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,597,623	1,599,859	
親投資信託受益証券 合計			1,599,859	
合計			902,334,065	

投資信託受益証券及び親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)



当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）」の受益証券（円建）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・プレミアム・トラスト - マルチアセット・インカム・アロケーション・ファンド（通貨セレクト・クラス）」の状況

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」に記載のとおりであります。

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の状況

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」に記載のとおりであります。

## 2 【ファンドの現況】

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース

## 【純資産額計算書】

平成29年2月28日

資産総額	2,595,664,162円
負債総額	5,522,458円
純資産総額（ - ）	2,590,141,704円
発行済数量	2,862,591,879口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9048円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年2月28日

資産総額	10,412,195,315円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	10,412,195,315円
発行済数量	10,397,391,340口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0014円

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コース

## 純資産額計算書

平成29年2月28日

資産総額	921,512,713円
負債総額	256,970円
純資産総額（ - ）	921,255,743円
発行済数量	967,477,082口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9522円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」の記載と同じ。

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コース

## 純資産額計算書

平成29年2月28日

資産総額	2,421,641,319円
負債総額	12,108,647円
純資産総額（ - ）	2,409,532,672円
発行済数量	2,898,552,179口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8313円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」の記載と同じ。

通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コース

## 純資産額計算書

平成29年2月28日

資産総額	915,313,236円
負債総額	253,689円
純資産総額（ - ）	915,059,547円
発行済数量	1,271,611,512口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.7196円

(参考) ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

前記「通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコース」の記載と同じ。

## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換えの手続き等

該当事項はありません。

## (2) 受益者に対する特典

ありません。

## (3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## (4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

## (5) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

## (6) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

## (7) 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

受益権の再分割を行なうにあたり、各受益者が保有する受益権口数に1口未満の端数が生じることとなる場合には、当該端数を切り捨てるものとし、当該端数処理は口座管理機関ごとに行ないます。また、各受益者が保有することとなる受益権口数の合計数と、受益権の再分割の比率に基づき委託会社が計算する受益権口数の合計数との間に差が生じることとなる場合には、委託会社が計算する受益権口数を当該差分減らし、当該口数にかかる金額については益金として計上することとします。

## (8) 償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された

受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として、)に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成29年2月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

##### ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

##### ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

##### ホ. ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

平成29年2月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	73	225,408
追加型株式投資信託	683	13,096,201
株式投資信託 合計	756	13,321,609
単位型公社債投資信託	15	102,779
追加型公社債投資信託	14	2,158,039
公社債投資信託 合計	29	2,260,819
総合計	785	15,582,427

## 3 【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第57期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第58期事業年度に係る中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	1	243
建物	21	18
器具備品	234	224
無形固定資産	2,759	2,706
ソフトウェア	2,758	2,385
ソフトウェア仮勘定	1	321



投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049
その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	2	2
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		

資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14
その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797

役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837
交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	1,226	1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-
その他		26		-
特別損失計		772		-
税引前当期純利益		19,651		19,471
法人税、住民税及び事業税		6,238		6,215

法人税等調整額	17	6
法人税等合計	6,220	6,209
当期純利益	13,431	13,262

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	494	494	38,360
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,126
当期純利益	-	-	13,431
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	208	208	208
当期変動額合計	208	208	3,513
当期末残高	702	702	41,873

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△422	△422	△422
当期変動額合計	△422	△422	△589
当期末残高	280	280	41,284

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間（5年間）に基づく定額法によっております。

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

### (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

### (3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

## (貸借対照表関係)

### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	20百万円	23百万円
器具備品	275百万円	232百万円

## 2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払金	4,084百万円	4,320百万円

## 3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,834百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万円に対して保証を行っております。

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
受取配当金	1,065百万円	-

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日
----------------------	------	--------	-------	----------------	----------------

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成27年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	13,428百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,148円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月24日

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27年 3月31日	平成27年 6月24日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

平成28年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	13,262百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,084円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。



## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されており、株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されており、

未払手数料は証券投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

## ( ) 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

## 信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）参照のこと）。

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,438	31,438	-
(2) 未収委託者報酬	10,295	10,295	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	10,520	10,520	-
資産計	52,254	52,254	-
(1) 未払手数料	4,965	4,965	-
(2) その他未払金	4,127	4,127	-
(3) 未払費用(*)	3,366	3,366	-
負債計	12,460	12,460	-

(\*) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,715	31,715	-
(2) 未収委託者報酬	9,896	9,896	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,987	7,987	-
資産計	49,599	49,599	-
(1) 未払手数料	4,330	4,330	-
(2) その他未払金	4,390	4,390	-
(3) 未払費用(*)	3,420	3,420	-
負債計	12,141	12,141	-

(\*) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項（有価証券関係）をご参照下さい。

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,025	1,021
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	996	1,049

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

（有価証券関係）

## 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	164	55	109
（2）その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,025百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	141	55	86
（2）その他 証券投資信託	3,875	3,408	466
小計	4,016	3,463	553
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,970	4,119	148
小計	3,970	4,119	148
合計	7,987	7,583	404

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,021百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（1）株式	32	-	1
（2）その他 証券投資信託	34,371	145	84
合計	34,404	145	85

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（1）株式	3	-	0
（2）その他 証券投資信託	19,069	115	13
合計	19,072	115	14

### 4．減損処理を行った有価証券

前事業年度において、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。

当事業年度において、証券投資信託について4百万円の減損処理を行っております。

## (退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、非積立型の確定給付制度(退職一時金制度であります)及び確定拠出制度を採用していません。

### 2. 確定給付制度

#### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,959百万円	2,072百万円
勤務費用	212	222
退職給付の支払額	118	120
その他	18	35
退職給付債務の期末残高	2,072	2,209

#### (2)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,072百万円	2,209百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209
退職給付引当金	2,072	2,209
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	212百万円	222百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	212	222

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度170百万円、当事業年度172百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	670	676
賞与引当金	305	225
外国税関連費用	241	-
未払事業税	231	224
連結法人間取引(譲渡損)	128	121
投資有価証券評価損	105	95
出資金評価損	103	98
その他	206	173
繰延税金資産小計	1,992	1,615
評価性引当額	613	347
繰延税金資産合計	1,379	1,268
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,203	2,086
その他有価証券評価差額金	335	124
繰延税金負債合計	2,539	2,210
繰延税金負債の純額	1,159	941

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.64%	33.06%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.14%	0.77%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.02%	0.02%
評価性引当額の増減額	2.67%	1.29%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.51%	0.19%
その他	0.07%	0.43%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.65%	31.89%

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が24百万円、繰延税金負債（長期）が74百万円、法人税等調整額が50百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が6百万円増加しております。

（セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

#### [関連情報]

##### 1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

###### （2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）  
該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）  
該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

## （ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,834	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,749	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

## （イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	978	長期差入保証金	971

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。



(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

### （1株当たり情報）

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,052.69円	1株当たり純資産額	15,826.85円
1株当たり当期純利益	5,148.94円	1株当たり当期純利益	5,084.10円

(注1)潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (平成28年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		22,153
有価証券		529
未収委託者報酬		9,521
繰延税金資産		428
その他		351
流動資産合計		32,984
固定資産		
有形固定資産	1	241
無形固定資産		
ソフトウェア		2,212
その他		252
無形固定資産合計		2,465
投資その他の資産		
投資有価証券		7,003
関係会社株式		5,129
その他		1,296
投資その他の資産合計		13,430
固定資産合計		16,137
資産合計		49,121

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（平成28年9月30日）

負債の部	
流動負債	
未払金	7,144
未払費用	3,762
未払法人税等	1,205
賞与引当金	733
その他	3 434
流動負債合計	13,279
固定負債	
退職給付引当金	2,301
役員退職慰労引当金	122
その他	9
固定負債合計	2,432
負債合計	15,712
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,184
利益剰余金合計	6,559
株主資本合計	33,229
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	179
評価・換算差額等合計	179
純資産合計	33,408
負債・純資産合計	49,121

## (2) 中間損益計算書

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（自 平成28年4月1日  
至 平成28年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		39,705
その他営業収益		356
営業収益合計		40,062
営業費用		
支払手数料		20,125
その他営業費用		5,997
営業費用合計		26,122
一般管理費	1	5,754
営業利益		8,184
営業外収益	2	165
営業外費用	3	59
経常利益		8,290
特別利益		-
特別損失	4	260
税引前中間純利益		8,029
法人税、住民税及び事業税		3,936
法人税等調整額		1,393
中間純利益		5,486

### (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,261	△ 13,261	△ 13,261
中間純利益	-	-	-	5,486	5,486	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 7,775	△ 7,775	△ 7,775
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,184	6,559	33,229

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,261
中間純利益	-	-	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	△ 100	△ 100	△ 100
当中間期変動額合計	△ 100	△ 100	△ 7,875
当中間期末残高	179	179	33,408

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## （２）無形固定資産

定額法によっております。

ただし、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（５年間）に基づく定額法によっております。

## ３．引当金の計上基準

### （１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

### （２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

### （３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

## ４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### （１）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

### （２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## （中間貸借対照表関係）

### １ 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日現在)
有形固定資産	273百万円

### ２ 保証債務

当中間会計期間（平成28年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,554百万円に対して保証を行っております。

## 3 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

## (中間損益計算書関係)

## 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	528百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
受取配当金	62百万円
投資有価証券売却益	53百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
為替差損	23百万円
投資有価証券売却損	16百万円

## 4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
MMF等償還関連費用	260百万円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608

合計	2,608	-	-	2,608
----	-------	---	---	-------

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(注2)参照のこと)。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,153	22,153	-
(2) 未収委託者報酬	9,521	9,521	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,511	6,511	-
資産合計	38,186	38,186	-
(1) 未払金	7,144	7,144	-
(2) 未払費用(*)	3,762	3,762	-
負債合計	10,906	10,906	-

(\*) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

負 債

## (1) 未払金及び(2) 未払費用



これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,051

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 5,129百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	111	55	56
(2) その他			
証券投資信託	3,994	3,627	366
小計	4,105	3,682	422
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	2,406	2,569	163
小計	2,406	2,569	163
合計	6,511	6,252	259

(注) 非上場株式(中間貸借対照表計上額 1,021百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(セグメント情報等)

[ セグメント情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[ 関連情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[ 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

[ 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報 ]

当中間会計期間（自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）

該当事項はありません。

（1 株当たり情報）

	当中間会計期間 （自 平成28年 4 月 1 日 至 平成28年 9 月30日）
1 株当たり純資産額	12,807.54円
1 株当たり中間純利益金額	2,103.26円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,486
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,486
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 みずほ信託銀行株式会社

資本金の額 247,369百万円（平成28年3月末現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称 大和証券株式会社

資本金の額 100,000百万円（平成28年3月末日現在）

事業の内容

金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

### 3 【資本関係】

該当事項はありません。

#### <再信託受託会社の概要>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（平成28年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

### 第3 【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨  
使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日  
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

(5) 交付目論見書に「大和投資信託からのメッセージ」として、以下の内容を記載することがあります。

## ∞ 大和投資信託からのメッセージ ∞

私どもは、安定した利回りを追求するため、世界各国のさまざまな資産から投資魅力度が高いものを発掘して投資するファンドを提供させていただいております。当ファンドには、取引対象通貨の異なる複数のコースがあり、お客さまにお選びいただける仕組みとなっております。

定期的に現金を受け取りたいお客さまのうち、お選びいただいた取引対象通貨の為替の変動の影響を受けることなど、通貨選択型ファンドの仕組みについてご理解いただける方に当ファンドの購入をご検討いただきたいと存じます。

お手持ちの資金を預貯金のほか、さまざまな資産に投資することをお考えのお客さまの運用商品のひとつとしてふさわしいと考えております。

私どもの商品が、お客さまの資産運用、資産形成の一助となれば幸いです。

なお、当ファンドは特別な仕組みを持った商品であり、最終的な商品の選択・購入にあたりましては、お客さまご自身で慎重にご判断くださいますようお願いいたします。

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



## 独立監査人の監査報告書

平成29年3月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コースの平成28年8月19日から平成29年2月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）日本円コースの平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年3月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコースの平成28年8月19日から平成29年2月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）為替ヘッジなしコースの平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年3月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コースの平成28年8月19日から平成29年2月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）ブラジル・リアル・コースの平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年3月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コースの平成28年8月19日から平成29年2月20日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター（毎月分配型）通貨セレクト・コースの平成29年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1 . 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年11月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。